

【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27日提出
【計算期間】	第1期(自 2021年8月3日至 2022年8月1日)
【ファンド名】	日興FWS・日本株インデックス 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり) 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし) 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり) 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし) 日興FWS・日本債インデックス 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり) 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし) 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり) 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし) 日興FWS・Jリートインデックス 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり) 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし) 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり) 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 各ファンドは、投資対象とする各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に投資対象とする資産へ投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

各マザーファンドおよびベンチマークについては後述の「2 投資方針」をご参照ください。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンド金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

日興FWS・日本株インデックス

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書または信託約款において、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います。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）

日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）

日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）

日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書または信託約款において、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います。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・日本債インデックス

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	債券	目論見書または信託約款において、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います。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	債券	目論見書または信託約款において、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います。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・Jリートインデックス

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	不動産投信	目論見書または信託約款において、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およ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います。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

項目	該当する商品分類	内容
----	----------	----

単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	不動産投信	目論見書または信託約款において、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およ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います。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	その他資産(商品)	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産(商品)を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

日興FWS・日本株インデックス

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(株式一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。

対象インデックス	TOPIX	目論見書または信託約款において、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	-------	--

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(株式一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル(日本を除く)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり(フルヘッジ)	目論見書または信託約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
対象インデックス	その他の指数(MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ヘッジ換算ベース))	目論見書または信託約款において、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(株式一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル(日本を除く)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース））	目論見書または信託約款において、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、株価指数先物取引）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および株価指数先物取引であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	エマージング	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（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います。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり（限定ヘッジ）	目論見書または信託約款において、対円での為替のフルヘッジまたは一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース））	目論見書または信託約款において、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、株価指数先物取引）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および株価指数先物取引であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	エマージング	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（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います。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（MSCIEマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース））	目論見書または信託約款において、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・日本債インデックス

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。

対象インデックス	その他の指数(NOMURA-BPI(総合))	目論見書または信託約款において、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	------------------------	---

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(債券一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「債券」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル(日本を除く)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり(フルヘッジ)	目論見書または信託約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
対象インデックス	その他の指数(F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース))	目論見書または信託約款において、F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(債券一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「債券」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル(日本を除く)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース））	目論見書または信託約款において、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	エマージング	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（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います。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり（フルヘッジ）	目論見書または信託約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジ換算ベース））	目論見書または信託約款において、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジ換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）

項目	該当する属性区分	内容
----	----------	----

投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	エマージング	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（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います。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース））	目論見書または信託約款において、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・Jリートインデックス

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（不動産投信））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は不動産投信であり、ファンドの収益は不動産投信市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「不動産投信」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。

対象インデックス	その他の指数(東証REIT指数(配当込み))	目論見書または信託約款において、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	------------------------	---

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(不動産投信))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は不動産投信であり、ファンドの収益は不動産投信市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「不動産投信」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル(日本を除く)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり(フルヘッジ)	目論見書または信託約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
対象インデックス	その他の指数(S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース))	目論見書または信託約款において、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(不動産投信))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は不動産投信であり、ファンドの収益は不動産投信市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「不動産投信」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル(日本を除く)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース））	目論見書または信託約款において、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（商品））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は金地金価格との連動を目指す上場投資信託証券であり、ファンドの収益は金市場（商品市場）の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「商品」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり（フルヘッジ）	目論見書または信託約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（LBMA金価格（円ヘッジ換算ベース））	目論見書または信託約款において、LBMA金価格（円ヘッジ換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）

項目	該当する属性区分	内容
----	----------	----

投資対象資産	その他資産(投資信託証券(商品))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は金地金価格との連動を目指す上場投資信託証券であり、ファンドの収益は金市場(商品市場)の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「商品」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル(日本を含む)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数(LBMA金価格(円換算ベース))	目論見書または信託約款において、LBMA金価格(円換算ベース)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

商品分類表

日興FWS・日本株インデックス

単体型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単体型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
		不動産投信	
		その他資産 ()	特殊型
	内外	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。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

単体型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単体型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
		不動産投信	
		その他資産 ()	特殊型
	内外	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。

日興FWS・日本債インデックス

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
		不動産投信	
		その他資産 ()	特殊型
	内外	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。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
		不動産投信	
		その他資産 ()	特殊型
	内外	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。

日興FWS・Jリートインデックス

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
		不動産投信	
	内外	その他資産 ()	特殊型
		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。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
		不動産投信	
	内外	その他資産 ()	特殊型
		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。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型		不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 (商品) 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

日興FWS・日本株インデックス

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般 大型株 中小型株	年2回	日本		日経225
	年4回	北米		
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回(隔月)	欧州		
公債				
社債	年12回(毎月)	アジア		
その他債券 クレジット属性 ()	日々	オセアニア		TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	
		アフリカ		
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		中近東(中東)		その他 ()
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定 型				
資産配分変更 型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド*	あり (フルヘッジ)	
一般 公債 社債 その他債 券	年6回(隔月)	欧州			
クレジット属 性 ()	年12回(毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		中近東(中東)			その他 (MSCIコクサイイ ンデックス (配当込み、円 ヘッジ換算ベー ス))
資産複合 ()		エマージング			
資産配分固 定型 資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債 券					
クレジット属 性 ()	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))					
		中近東(中東)			その他 (MSCIコクサイ ンデックス (配当込み、円 ベース))
資産複合 ()		エマージング			
資産配分固 定型 資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

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
株式	年1回	グローバル			
一般 大型株	年2回	日本			日経225
中小型株	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド*	あり (限定ヘッジ)	
一般 公債	年6回(隔月)	欧州			TOPIX
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債 券 クレジット属 性 ()	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、株価指数先 物取引)資産配 分変更型))		中近東(中東)			その他 (MSCIエマージ ング・マーケット インデックス (配当込み、米ド ル円ヘッジ換算 ベース))
資産複合 () 資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

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
株式	年1回	グローバル			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債 券					
クレジット属 性 ()	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、株価指数先 物取引)資産配 分変更型))					その他 (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))
資産複合 () 資産配分固 定型 資産配分変 更型		中近東(中東) エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・日本債インデックス

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般 大型株 中小型株	年2回	日本		日経225
	年4回	北米		
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回(隔月)	欧州		
公債				
社債	年12回(毎月)	アジア		
その他債券				
クレジット属性 ()	日々	オセアニア		TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	
		アフリカ		
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))				その他 (NOMURA - BPI (総合))
		中近東(中東)		
資産複合 ()				
資産配分固定 型		エマージング		
資産配分変更 型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド*	あり (フルヘッジ)	
一般 公債 社債 その他債 券 クレジット属 性 ()	年6回(隔月)	欧州			
	年12回(毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))		中近東(中東)			その他 (FTSE世界国債 インデックス (除く日本、円ヘッ ジベース))
資産複合 () 資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債 券					
クレジット属 性 ()	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))					
		中近東(中東)			その他 (FTSE世界国債 インデックス (除く日本、円 ベース))
資産複合 ()		エマージング			
資産配分固 定型 資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

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
株式	年1回	グローバル			
一般					
大型株	年2回	日本			日経225
中小型株	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債					
券					
クレジット属性	日々	オセアニア			TOPIX
()					
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))					
		中近東(中東)			その他 (JPモルガン・エ マーシング・マー ケット・ボンド・イ ンデックス・プラス (円ヘッジ換算 ベース))
資産複合 ()		エマージング			
資産配分固 定型					
資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

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
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券 一般 公債 社債 その他債 券 クレジット属 性 ()	年6回(隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
	年12回(毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信 ()	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))					その他 (JPモルガン・エ マージング・マー ケット・ボンド・イ ンデックス・プラス (円換算ベース))
資産複合 () 資産配分固 定型 資産配分変 更型		中近東(中東) エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・Jリートインデックス

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般 大型株 中小型株	年2回	日本		日経225
	年4回	北米	ファミリーファンド	
債券				
一般	年6回(隔月)	欧州		
公債				
社債	年12回(毎月)	アジア		
その他債券				
クレジット属性 ()	日々	オセアニア		TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	
		アフリカ		
その他資産 (投資信託証券 (不動産投信))				その他 (東証REIT指数(配 当込み))
		中近東(中東)		
資産複合 ()				
資産配分固定 型		エマージング		
資産配分変更 型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド*	あり (フルヘッジ)	
一般 公債 社債 その他債 券 クレジット属 性 ()	年6回(隔月)	欧州			
	年12回(毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (不動産投信))		中近東(中東)			その他 (S&P先進国RE IT指数 (除く日本、配当 込み、円ヘッジ換 算ベース))
資産複合 () 資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債 券					
クレジット属 性 ()	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (不動産投信))					その他 (S&P先進国RE IT指数 (除く日本、配当 込み、円換算 ベース))
資産複合 ()					
資産配分固 定型		中近東(中東)			
資産配分変 更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

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
株式	年1回	グローバル (日本を含む)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	
一般 公債	年6回(隔月)	欧州			
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債 券					
クレジット属 性 ()	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (商品))		中近東(中東)			その他 (LBMA金価格 (円ヘッジ換算 ベース))
資産複合 ()		エマージング			
資産配分固 定型					
資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

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
株式	年1回	グローバル (日本を含む)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般 公債 社債 その他債 券	年6回(隔月)	欧州			
クレジット属 性 ()	年12回(毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信 ()	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (商品))		中近東(中東)			その他 (LBMA金価格 (円換算ベース))
資産複合 ()		エマージング			
資産配分固 定型 資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

(2) 【ファンドの沿革】

2021年8月3日 信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友DSアセットマネジメント株式会社」

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

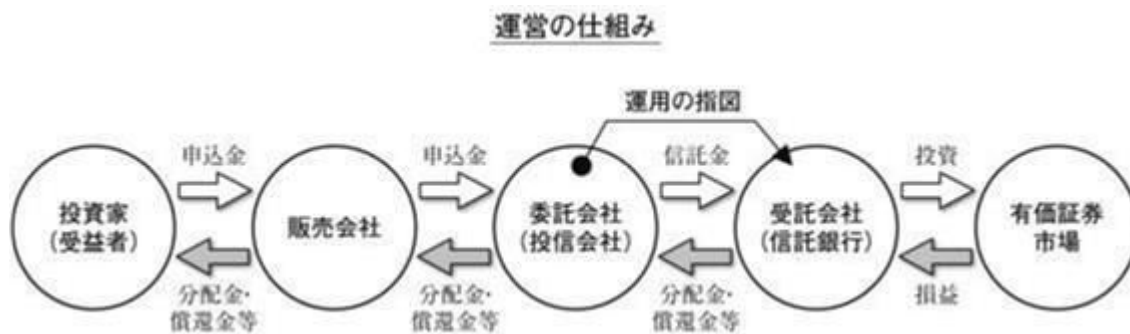
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一

部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(八) 販売会社

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



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2022年7月29日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

(ハ) 大株主の状況

（2022年7月29日現在）

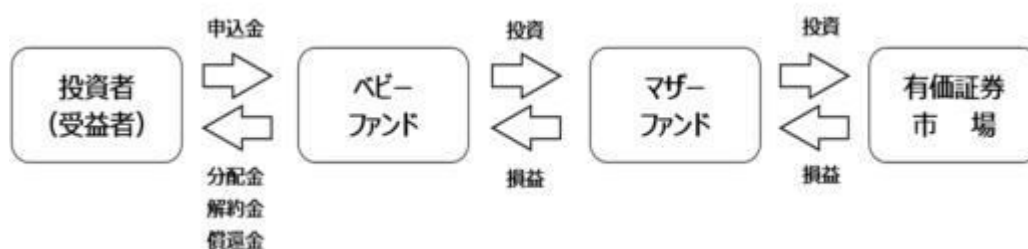
名称	住所	所有 株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

八 ファンドの運用形態

各ファンド（日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）および日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）を除く）

（ファミリーファンド方式による運用）

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。

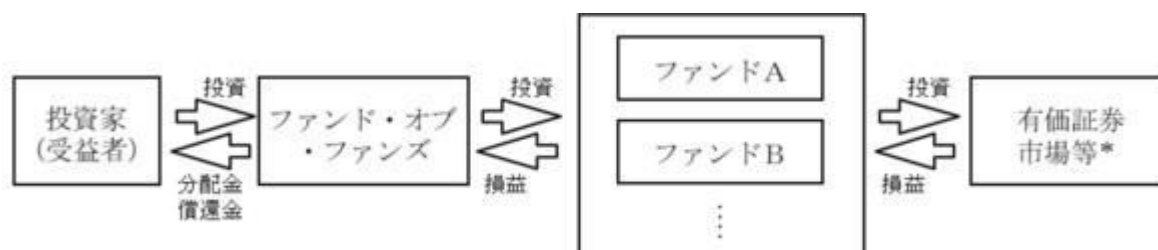


日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）

（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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



*当ファンドにおいては金現物を含みます。

なお、当ファンドは、「ファミリーファンド方式」を採用しており、実際の他のファンドへの投資は、マザーファンドを通じて行います。

2【投資方針】

（1）【投資方針】

イ 基本方針

各ファンドは、投資対象とする各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に投資対象とする資産へ投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

日興FWS・日本株インデックス

（イ）国内株式インデックス・マザーファンド（B号）への投資を通じて、主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資することにより、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

- (ロ) 株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

- (イ) 外国株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行うことにより、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 外国株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。一部の通貨建資産については為替ヘッジが困難等と判断された場合、他の通貨で代替した為替取引を行うことまたは為替ヘッジを行わないことがあります。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

- (イ) 外国株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資することにより、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 外国株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

- (イ) エマージング株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式(預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、実質組入外貨建資産について原則として米ドル売り円買いの為替取引を行うことにより、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。
- (ロ) エマージング株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として米ドル売り円買いの為替取引を活用し、為替変動リスクの低減を図ります。そのため、米ドル建て以外の通貨建資産については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

- (イ) エマージング株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式(預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資することにより、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社

債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。

- (ロ) エマージング株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質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せん。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・日本債インデックス

- (イ) 国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンドへの投資を通じて、主として日本の公社債に投資することにより、NOMURA - BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 運用の効率化を図るため、有価証券先物取引等を利用することもあります。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

- (イ) ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資し、実質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により、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質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活用し、為替変動リスクの低減を図ります。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

- (イ) 外国債券パッシブ・マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外国債券パッシブ・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質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せん。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

- (イ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資し、実質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により、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- (ロ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質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活用し、為替変動リスクの低減を図ります。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

- (イ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資することにより、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- (ロ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

日興FWS・Jリートインデックス

- (イ) Jリート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
- ・主として日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(REIT)に投資することにより、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
 - ・不動産投資信託(REIT)への投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
 - ・ベンチマークとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引等を活用する場合があります。このため、不動産投資信託(REIT)の実質組入時価総額と不動産投信指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が純資産総額を超えることがあります。
- (ロ) Jリート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
(ハ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

- (イ) 外国リート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
- ・日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)等に投資し、実質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うことにより、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
 - ・不動産投資信託(REIT)等への投資にあたっては、S&P先進国REIT指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
- (ロ) 外国リート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
(ハ) 実質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活用し、為替変動リスクの低減を図ります。一部の通貨建資産については為替ヘッジが困難等と判断された場合、他の通貨で代替した為替取引を行うことまたは為替ヘッジを行わないことがあります。
(二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

- (イ) 外国リート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
- ・日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)等に投資することにより、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指して運用を行います。
 - ・不動産投資信託(REIT)等への投資にあたっては、S&P先進国REIT指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
- (ロ) 外国リート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
(ハ) 実質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せん。
(二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

- (イ) ゴールド・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として、金地金価格との連動を目指す投資信託証券に投資し、実質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により、ロンドン貴金属市場協会(LBMA)金価格(円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) ゴールド・インデックス・マザーファンドが主要投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性及び運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

- (ハ) ゴールド・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 実質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活用し、為替変動リスクの低減を図ります。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

- (イ) ゴールド・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として、金地金価格との連動を目指す投資信託証券に投資することにより、ロンドン貴金属市場協会(LBMA)金価格(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) ゴールド・インデックス・マザーファンドが主要投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性及び運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。
- (ハ) ゴールド・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 実質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せん。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの特色

1

「日興ファンドラップ セレクト インデックス・シリーズ」は、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産管理を行う口座の資金を運用するための専用ファンドです。

※「日興ファンドラップ セレクト インデックス・シリーズ」のご購入のお申込みには、販売会社のラップ口座の開設が必要です。

2

「日興ファンドラップ セレクト インデックス・シリーズ」は、複数ファンドで構成されており、各ファンドは投資対象とする各マザーファンドへの投資を通じて、実質的に投資対象とする資産に投資します。

※各マザーファンドおよび投資対象とする資産については後掲の「ファンドのしくみ」をご参照ください。

3

各ファンドは、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

ファンド名	ベンチマーク
日本株インデックス	TOPIX(東証株価指数、配当込み)
先進国株インデックスヘッジ有	MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ヘッジ換算ベース)
先進国株インデックスヘッジ無	MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)
新興国株インデックスヘッジ有	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース)
新興国株インデックスヘッジ無	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)
日本債インデックス	NOMURA-BPI(総合)
先進国債インデックスヘッジ有	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)
先進国債インデックスヘッジ無	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債インデックスヘッジ有	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ換算ベース)
新興国債インデックスヘッジ無	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)
Jリートインデックス	東証REIT指数(配当込み)
Gリートインデックスヘッジ有	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース)
Gリートインデックスヘッジ無	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)
ゴールドヘッジ有	LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)
ゴールドヘッジ無	LBMA金価格(円換算ベース)

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

ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式を採用し、マザーファンドの組入れを通じて、実際の運用を行います。

▶各ファンド(ゴールドヘッジ有、ゴールドヘッジ無を除く)



※上記における各ファンド、各マザーファンドおよび各投資対象資産は以下のとおりになります。

ファンド	マザーファンド	投資対象資産
日本株インデックス	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	日本の株式等
先進国株インデックスヘッジ有	外国株式インデックス・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域の株式等
先進国株インデックスヘッジ無	外国株式インデックス・マザーファンド	
新興国株インデックスヘッジ有	エマージング株式インデックス・マザーファンド	新興国の株式および 株式指数先物取引等
新興国株インデックスヘッジ無	エマージング株式インデックス・マザーファンド	
日本債インデックス	国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド	日本の公社債等
先進国債インデックスヘッジ有	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域の公社債等
先進国債インデックスヘッジ無	外国債券パッシブ・マザーファンド	
新興国債インデックスヘッジ有	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	新興国の公社債等
新興国債インデックスヘッジ無	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	
Jリートインデックス	Jリート・インデックス・マザーファンド	日本のリート等
Gリートインデックスヘッジ有	外国リート・インデックス・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域のリート等
Gリートインデックスヘッジ無	外国リート・インデックス・マザーファンド	

▶ゴールドヘッジ有、ゴールドヘッジ無



各ファンドの運用の基本方針等

▶ 国内株式

日本株インデックス

ベンチマーク TOPIX(東証株価指数、配当込み)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
※株価指数先物取引等を利用することがあります。

▶ 先進国株式

先進国株インデックスヘッジ有・・・為替ヘッジあり

ベンチマーク MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ヘッジ換算ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
※株価指数先物取引等を利用することがあります。
- 実質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、為替変動リスクの低減を図ります。
※一部の通貨建資産については為替ヘッジが困難等と判断された場合、他の通貨で代替した為替取引を行うことまたは為替ヘッジを行わないことがあります。

先進国株インデックスヘッジ無・・・為替ヘッジなし

ベンチマーク MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
※株価指数先物取引等を利用することがあります。
- 実質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せん。
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

▶ 新興国株式

新興国株インデックスヘッジ有・・・限定為替ヘッジ

ベンチマーク MSCIEマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式*、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を対象とする上場投資信託証券(ETF)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
*預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券等を含みます。
※ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券(ETF)、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。
- 実質組入外貨建資産については、原則として米ドル売り円買いの為替取引を行い、為替変動リスクの低減を図ります。
※米ドル建て以外の通貨建資産については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。

新興国株インデックスヘッジ無・・・為替ヘッジなし

ベンチマーク	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)
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式*、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を対象とする上場投資信託証券(ETF)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 *預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。 ※ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券(ETF)、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。 ● 実質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せん。 ※基準価額は為替変動の影響を受けます。

**預託証書(DR)とは**

Depository Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

国内債券**日本債インデックス**

ベンチマーク	NOMURA-BPI(総合)
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● マザーファンドへの投資を通じて、主として日本の公社債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

先進国債券**先進国債インデックスヘッジ有・・・為替ヘッジあり**

ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ※FTSE世界国債インデックスには、2021年11月より、段階的に中国国債の組入れが開始されています。 ● 実質組入外貨建資産については、マザーファンドにおいて、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。 ※完全に為替変動リスクを回避することはできません。

先進国債インデックスヘッジ無・・・為替ヘッジなし

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)
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ※FTSE世界国債インデックスには、2021年11月より、段階的に中国国債の組入れが開始されています。 ● 実質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せん。 ※基準価額は為替変動の影響を受けます。

▶ 新興国債券

新興国債インデックスヘッジ有・・・為替ヘッジあり

ベンチマーク JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ換算ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
※運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- 実質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、為替変動リスクの低減を図ります。
※完全な為替変動リスクを回避することはできません。

新興国債インデックスヘッジ無・・・為替ヘッジなし

ベンチマーク JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
※運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- 実質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せん。
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

▶ 国内リート

Jリートインデックス

ベンチマーク 東証REIT指数(配当込み)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
※不動産投信指数先物取引等を利用することがあります。

▶ 外国リート

Gリートインデックスヘッジ有・・・為替ヘッジあり

ベンチマーク S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- 実質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、為替変動リスクの低減を図ります。
※一部の通貨建資産については為替ヘッジが困難等と判断された場合、他の通貨で代替した為替取引を行うことまたは為替ヘッジを行わないことがあります。

Gリートインデックスヘッジ無・・・為替ヘッジなし

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)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- 実質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せん。
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

▶ 金

ゴールドヘッジ有・・・為替ヘッジあり

ベンチマーク LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)

運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● マザーファンドへの投資を通じて、金地金価格との連動を目指す投資信託証券*に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ※マザーファンドが投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性および運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。 ※実質的な投資対象とする投資信託証券は、以下の通りです。 [iShares Gold Trust] [SPDR Gold MiniShares Trust] ただし、一部の投資信託証券のみの投資となる場合があります。 ● 実質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、為替変動リスクの低減を図ります。 ※完全な為替変動リスクを回避することはできません。
---------	---

ゴールドヘッジ無・・・為替ヘッジなし

ベンチマーク LBMA金価格(円換算ベース)

運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● マザーファンドへの投資を通じて、金地金価格との連動を目指す投資信託証券*に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ※マザーファンドが投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性および運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。 ※実質的な投資対象とする投資信託証券は、以下の通りです。 [iShares Gold Trust] [SPDR Gold MiniShares Trust] ただし、一部の投資信託証券のみの投資となる場合があります。 ● 実質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せん。 ※基準価額は為替変動の影響を受けます。
---------	--

■ ゴールド・インデックス・マザーファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

ファンド名	iShares Gold Trust (iシェアーズ ゴールド・トラスト)	SPDR Gold MiniShares Trust (SPDR* ゴールド・ミニシェアーズ・トラスト)
形態	米国籍上場投資信託(米ドル建て)	米国籍上場投資信託(米ドル建て)
管理会社	iShares デラウェア・トラスト・スポンサー・エルエルシー	WGC USAアセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
運用の基本方針	金地金価格の変動に概ね連動することを目標とします。	金地金の価格のパフォーマンスを反映させることを目標とします。
ベンチマーク	LBMA金価格	LBMA金価格
管理費用*1	年0.25%	年0.10%
購入の可否*2	日本において一般投資者の購入が可能です。	日本において一般投資者の購入が可能です。

※1 管理費用とは各上場投資信託(以下「ETF」といいます。)の運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値は各ETFの直近の目論見書等で開示されているものです。

※2 外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接、購入することができるものがあります。直接購入される際は、売買委託手数料(証券会社ごとに異なります。)がかかります。また、円貨と外貨を交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります。

為替の影響について

▶ 為替ヘッジあり

為替ヘッジあり*

為替変動の影響は限定的

*為替ヘッジコストがかかります。

- 外貨建資産に対し、対円での為替ヘッジを行う場合、基準価額への為替変動の影響は小さくなると考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。



為替ヘッジ

為替取引等を利用し、為替変動リスクを低減することです。

▶ 限定為替ヘッジ



外貨建資産とほぼ同額程度の
米ドル売り円買いの為替取引

為替取引後

米ドル建て資産

為替変動リスクは
低減されます。

米ドル建て以外の資産

米ドルに対する組入通貨の
為替変動の影響を受けます。

- 原則として外貨建資産とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、対円での為替変動リスクの低減を図ります。なお、実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。

(注) 左記は、限定為替ヘッジについて理解を深めていただくためのイメージです。

▶ 為替ヘッジなし

為替ヘッジなし

円安の場合(為替差益)
基準価額にプラス

円高の場合(為替差損)
基準価額にマイナス

- 外貨建資産に対し、対円での為替ヘッジを行わない場合、基準価額は為替変動の影響を受けます。

各ファンドの運用プロセス



*ユニバースの決定を行わないファンドもあります。

[ポートフォリオの構築手法]

構築手法	ファンド名
最適化法	日本株インデックス、先進国株インデックスヘッジ有、先進国株インデックスヘッジ無、新興国株インデックスヘッジ有、新興国株インデックスヘッジ無
層化抽出法	日本債インデックス、先進国債インデックスヘッジ有、先進国債インデックスヘッジ無、新興国債インデックスヘッジ有、新興国債インデックスヘッジ無
完全法	Jリートインデックス、Gリートインデックスヘッジ有、Gリートインデックスヘッジ無



最適化法とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるように、インデックス構成銘柄の一部を抽出してポートフォリオを構築する方法です。

層化抽出法とは

指数を構成する銘柄をいくつかのグループ(層)に分け、それぞれのグループから代表銘柄を抽出して構成銘柄を選択し、ポートフォリオを構築する方法です。

完全法とは

指数を構成するすべての銘柄について、その時価構成比率に合わせて保有し、ポートフォリオを構築する方法です。

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

※ゴールドヘッジ有およびゴールドヘッジ無については、金現物に投資する投資信託証券への投資により、インデックスの動きへの連動を目指した運用を行います。

追加的記載事項

●各ファンドがベンチマークとする指数の著作権等について

<日本株インデックス、Jリートインデックス>

- TOPIX、東証REIT指数の指数値およびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIX、東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。
- J P Xは、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIX、東証REIT指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- J P Xは、TOPIX、東証REIT指数の指数値およびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIX、東証REIT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。
- J P Xは、TOPIX、東証REIT指数の指数値およ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、J P Xは、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 当ファンドは、TOPIX、東証REIT指数に連動した投資成果を目標として運用しますが、当ファンドの基準価額とTOPIX、東証REIT指数の指数値の間に乖離が発生する可能性があります。
- 当ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。
- J P Xは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- J P Xは、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIX、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、J P Xは当ファンドの設定、販売およ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。

<先進国株インデックスヘッジ有、先進国株インデックスヘッジ無、新興国株インデックスヘッジ有、新興国株インデックスヘッジ無>

MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ヘッジ換算ベース/円ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース/円ベース)は、MSCI INC.(以下「MSCI」)が公表する指数(MSCIコクサイインデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックス)を委託会社が独自に計算したものです。その指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCIに帰属します。また、当ファンドを同社が保証するものではありません。

当ファンドは、MSCI、その関連会社、情報提供会社またはMSCI INDEXの編集または計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、売却または宣伝するものではありません。

MSCI INDEXは、MSCIの専有財産です。

MSCIおよびMSCI INDEXの名称は、MSCIもしくはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のための使用について許可されているものです。

いかなるMSCI当事者も、委託会社、受益者、またはその他の個人もしくは事業体に対して、ファンド投資一般、当ファンドへの投資、もしくはMSCI INDEXが対応する株式市場パフォーマンスを記録する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明または保証を行いません。

MSCIもしくは関連会社は、当ファンド、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体とは無関係にMSCIが決定、構成、計算するMSCI INDEXに関する特定の商標、サービスマーク、商号のライセンサーです。

いかなるMSCI当事者も、MSCI INDEXについて決定、構成または計算するにあたり、委託会社または受益者、またはその他のあらゆる個人または事業体のニーズを考慮する義務を負いません。

いかなるMSCI当事者も、当ファンドの発行時期、価格、数量に関する決定、当ファンドの償還価格および数式の決定および算定に参加しておらず、かつその責任を負いません。

さらに、いかなるMSCI当事者も、当ファンドの運営、マーケティング、またはオフリングに関連して、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体に対して一切の義務または責任を負いません。

MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI INDEXの算出に使用するための情報を入手するものとしませんが、いずれのMSCI当事者も、MSCI INDEXまたはそのデータの獨創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体がMSCI INDEXもしくはそのデータを使用して得る情報またはその結果に関して、明示・黙示の保証をしません。

MSCI当事者は、MSCI INDEXもしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示・黙示の保証責任も負わず、MSCI INDEXもしくはそのデータに関して、商品性および特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなるMSCI当事者も、直接、間接、特別、懲罰的、結果的な損害、およびその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

<日本債インデックス>

NOMURA-BPIIに関する一切の知的財産権その他の一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

<先進国債インデックスヘッジ有、先進国債インデックスヘッジ無>

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース/円ベース)とは、FTSE Fixed income LLCが算出し公表している指数(FTSE世界国債インデックス)をもとに、委託会社が計算したものです。FTSE世界国債インデックスに関する知的所有権その他一切の権利はFTSE Fixed income LLCに帰属します。

また、同社は当ファンドの運用に関して責任を負うものではありません。

<新興国債インデックスヘッジ有、新興国債インデックスヘッジ無>

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ換算ベース/円換算ベース)とは、J.P.モルガン・セキュリティー・エルエルシーが算出し公表している指数(JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス)をもとに、委託会社が計算したものです。同指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティー・エルエルシーに帰属しております。

JPモルガン指数(以下「指数」といいます。)について提供された情報は、指数のレベルも含め、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買の申込み若しくは勧誘、何らかの取引の公式なコンファメーション、又は指数に関連する何らかの商品の価値算定若しくは値段を構成するものではありません。また、ここに記載されるいかなる情報も、一定の投資戦略の採用を推奨するものとも、法務、税務又は会計上の助言としても理解されてはなりません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は、一般に信頼できるとされているものですが、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー(以下「JPMorgan」といいます。)は、その完全性又は正確性を保証するものではありません。ここに含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは不確定の将来の収益を示すものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMorgan、JPMorganの関係会社又はその従業員がロング若しくはショートのポジションを持ち、売買等を行い、又はマーケットメイクをすることがあり、また、そのような発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、又は貸主になる場合もあります。

米国のJ.P.モルガン・セキュリティー・エルエルシー(以下「JPMS」といいます。)は、いかなる指数に関連する証券、金融商品又は取引(以下「プロダクト」といいます。)についての援助、保証又は販売促進も行いません。証券若しくは金融商品全般若しくは特定のプロダクトへの投資の妥当性について、又は金融市場における投資機会を指数に連動させることとするものの妥当性について、JPMSは明示又は黙示を問わず、一切の表明又は保証を行いません。JPMSはプロダクトの管理、マーケティング又はトレーディングに関する義務又は責任を負いません。指数は一般に信用できるとされている要素に依拠していますが、JPMSは、その完全性、正確性又は指数に付随して提供されるその他の情報について保証するものではありません。

指数はJPMSのみが保有する財産であり、その財産権は全てJPMSに帰属します。

JPMSはNASD、NYSE、SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA、JPMS、J.P. Morgan Securities Ltd. (FSAの登録を受けたLSEの会員)又はその投資銀行関連会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

当情報の著作権はジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

上記和文は下記URLに記載される英文の参考訳であり、英文と上記和文の記載に齟齬がある場合、英文が優先されます。

<https://www.jpmorgan.com/disclosures/girg>

<Gリートインデックスヘッジ有、Gリートインデックスヘッジ無>

S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース/円換算ベース)は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表する指数(S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み))を基に委託会社が独自に計算した値を用いています。

S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに帰属します。また、当ファンドを同社が保証するものではありません。

S&P先進国REIT指数は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社([SPDJ])の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's® およびS&P*は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC([S&P])の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC([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SPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが委託会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P先進国REIT指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対して一切の責任も負いません。

<ゴールドヘッジ有、ゴールドヘッジ無>

LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース/円換算ベース)とは、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)が算出し公表している指数(LBMA金価格)をもとに、委託会社が計算したものです。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。

(2)【投資対象】**イ 投資対象とする資産の種類**

- 日興FWS・日本株インデックス
- 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・日本債インデックス
- 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・Jリートインデックス
- 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- (イ) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。)
1. 有価証券
 2. デリバティブ取引にかかる権利
 3. 約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)
 4. 金銭債権
- (ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産
1. 為替手形

- 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- (イ) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をい

ます。以下同じ。)

1. 有価証券

2. 約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)

3. 金銭債権

(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

口 投資対象とする有価証券

日興FWS・日本株インデックス

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・日本債インデックス

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

委託会社は、信託金を、主として、各マザーファンドの受益証券または次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. 資産の流動化に関する法律に規定する特定目的信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。)

11. コマーシャル・ペーパー

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

13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。次号において同じ。))で次号に定めるもの以外のもの

16. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

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

18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)

19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、第1号の証券または証書、ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第16号の証券ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第16号の証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券ならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

日興FWS・Jリートインデックス

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンドの受益証券または次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
5. 投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、第1号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引(売戻条件付の買入れ)および債券貸借取引(現金担保付債券借入れ)に限り行うことができます。また、第4号の証券および第5号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンドの受益証券または次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
5. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、第1号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引(売戻条件付の買入れ)および債券貸借取引(現金担保付債券借入れ)に限り行うことができます。また、第4号の証券および第5号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

八 投資対象とする金融商品

- 日興FWS・日本株インデックス
- 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・日本債インデックス
- 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

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

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

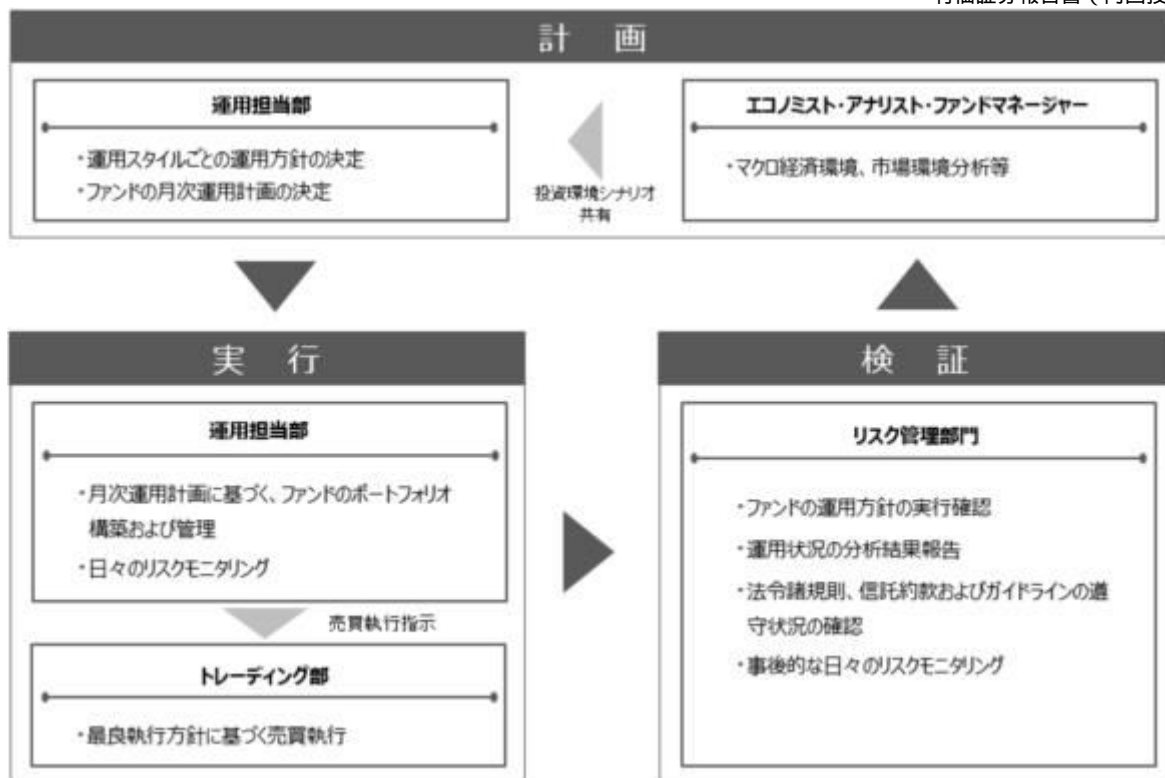
- 日興FWS・Jリートインデックス
- 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

- 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制
ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

（４）【分配方針】

年1回（原則として毎年7月31日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限
日興FWS・日本株インデックス

- イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た

率を合計したものをいいます（以下同じ。）。

- 外貨建資産への投資は行いません。
- 八 投資信託証券（マザーファンド受益証券およ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%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）

日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）

日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）

日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）

- イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 八 投資信託証券（マザーファンド受益証券およ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%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・日本債インデックス

- イ 株式への投資は、転換社債の転換、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。）の新株予約権の行使による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 外貨建資産への投資は行いません。
- 八 投資信託証券（マザーファンド受益証券およ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%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）

日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）

- イ 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 国債を除く同一発行体の発行する債券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 八 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券（マザーファンド受益証券およ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%以下とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）

日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）

- イ 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純

資産総額の10%以下とします。

- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 八 投資信託証券（マザーファンド受益証券およ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%以下とします。
- 二 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・Jリートインデックス

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- 株式への投資は行いません。
- 八 外貨建資産への投資は行いません。
- 二 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）

日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- 株式への投資は行いません。
- 八 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 二 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- 八 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 二 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、原則として制限を設けません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

日興FWS・日本株インデックス

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

- 投資する株式等の範囲

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

八 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

二 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ヘ 金利先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

ト 有価証券の貸付けの指図

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

チ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

リ 有価証券の借入れの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。

(ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が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有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

(二) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ヌ 資金の借入れ

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

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

(二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

ロ 投資する株式等の範囲

(イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

ハ 信用取引の指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの

指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- (ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

二 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が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金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (チ) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (リ) 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

ト 有価証券の貸付けの指図

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

チ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしてします。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

リ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が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有価証券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)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ヌ 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、日本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。

ル 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ロ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

日興FWS・日本債インデックス

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

ロ 投資する株式等の範囲

委託会社が投資することを指図する株式は、転換社債の転換、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。)の新株予約権の行使による取得に限り、日本の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

八 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (二) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

二 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の

取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)。

- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ヘ 金利先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸

借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

ト 有価証券の貸付けの指図

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

チ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

リ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が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有価証券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)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ヌ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

- (八) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

ロ 投資する株式等の範囲

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

ハ 同一発行体の発行する公社債への投資制限

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する同一の発行体にかかる公社債(日本および外国の国債証券を除きます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該同一発行体にかかる公社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- (ロ) 上記(イ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ニ 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (二) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ホ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外

国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

- (八) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ヘ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ト 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が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金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出

した価額により行うものとします。

- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (チ) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (リ) 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

チ 有価証券の貸付けの指図

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

リ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ヌ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が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有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (二) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ル 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、日本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。

ヲ 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 外国為替予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (二) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ワ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
 1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

日興FWS・Jリートインデックス

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

ロ 公社債の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が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)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ハ 先物取引等の指図

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるもののうち、不動産投信指数にかかるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれと類似の取引を行うことの指図をすることができます。

二 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
 1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

ロ 公社債の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が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)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ハ 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、日本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。

二 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、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。

ホ 先物取引等の指図

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるもののうち、不動産投信指数にかかるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれと類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ヘ 資金の借入れ

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

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

(ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

イ 公社債の借入れの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。

(ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が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)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ロ 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、日本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。

ハ 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファン

どの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、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。

二 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)
委託会社は、運用財産に関し、信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

(参考情報：マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

主として日本の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ハ) 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除き、かつ本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
5. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
7. 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。)

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・日本株インデックスが投資対象とする金融商品の各号のうち、第1号から第4号に掲げるものに投資します。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。
- (ハ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ニ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(外国株式インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

□ 投資態度

- (イ) 主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 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わないものとします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

□ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 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（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
5. コマーシャル・ペーパー
6. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みません。以下同じ。）および新株予約権証券
7. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
8. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
9. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
10. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
11. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
12. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）および日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）が投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式への投資割合には制限を設けません。
- (ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- (ハ) 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

スプージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(二) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(ホ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(エマーシング株式インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

M S C Iエマーシング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として新興国の株式(預託証券(D R)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、M S C Iエマーシング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

(ロ) 運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。

(ハ) 外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
 17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- 八 投資対象とする金融商品
- 前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)および日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式への投資割合には制限を設けません。
- (ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- (ハ) 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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ニ) 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割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ホ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ヘ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (ト) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日本の公社債を中心に投資し、安定した利子等収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主として日本の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、NOMURA - BPIの動きに連動する投資成果を目指します。

(ロ) 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および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における日本の有価証券先物取引、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および金利に係るオプション取引と類似の取引(「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです(為替手形を除きます。)

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 国債証券
2. 地方債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 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を除きます。)
5. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 5の2. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
6. コマーシャル・ペーパー
7. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
8. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
9. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・日本債インデックスが投資対象とする金融商品の各号のうち、第1号から第4号に掲げるものに投資します。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資は行いません。
- (ロ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ハ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建て資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)が投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ハ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ニ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ホ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 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割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ト) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (チ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (リ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

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

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

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。))への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

- (ニ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 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割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ト) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (チ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主として米ドル建ての新興国の公社債に投資することにより、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- (ロ) 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せん。
- (ハ) 公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載した日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)および日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載した日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)および日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする有価証券の各号に掲げるものに投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)および日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (ロ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ハ) 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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ニ) 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

スポンジャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(Jリート・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)されている不動産投資信託(REIT)を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) 不動産投資信託(REIT)への投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
- (ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 東証REIT指数先物取引等を活用することがあります。このため不動産投資信託への投資総額と東証REIT指数先物取引等の買建玉の投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
5. 投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・Jリートインデックスが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- (ロ) 株式への投資は行いません。
- (ハ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ニ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなっ

た場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(ホ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(外国リート・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)などを主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

(ロ) 不動産投資信託(REIT)などへの投資にあたっては、S & P先進国REIT指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。

(ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。

(ニ) 外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行わないものとします。

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーフンドが投資対象とする資産の種類に同じです(デリバティブ取引にかかる権利を除きます。)

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの

4. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

5. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)および日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 株式への投資は行いません。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

(ホ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(ゴールド・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

L B M A金価格(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券に投資することにより、ロンドン貴金属市場協会(L B M A)金価格(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性及び運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券とは、下記のものとしします。

iShares Gold Trust

SPDR Gold MiniShares Trust

(ロ) 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せん。

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載した日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)および日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)が投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載した日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)および日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)が投資対象とする有価証券の各号に掲げるものに投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)および日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)が投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(ニ) 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、原則として制限を設けません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

(ホ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなっ

た場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

各ファンドの主要なリスクは以下の通りです。内容につきましては、後掲をご覧ください。

ファンド名	価格変動リスク				信用 リスク	為替変動リスク			カントリー リスク	流動性 リスク
	株式市場 リスク	債券市場 リスク	不動産 投資信託 (リート) に関する リスク	金に 関する リスク		為替 ヘッジ あり	限定 為替 ヘッジ	為替 ヘッジ なし		
日本株インデックス	●				●					●
先進国株インデックス ヘッジ有	●				●	●			●	●
先進国株インデックス ヘッジ無	●				●			●	●	●
新興国株インデックス ヘッジ有	●				●		●		●	●
新興国株インデックス ヘッジ無	●				●			●	●	●
日本債インデックス		●			●					●
先進国債インデックス ヘッジ有		●			●	●			●	●
先進国債インデックス ヘッジ無		●			●			●	●	●
新興国債インデックス ヘッジ有		●			●	●			●	●
新興国債インデックス ヘッジ無		●			●			●	●	●
Jリートインデックス			●		●					●
Gリートインデックス ヘッジ有			●		●	●			●	●
Gリートインデックス ヘッジ無			●		●			●	●	●
ゴールドヘッジ有				●	●	●			●	●
ゴールドヘッジ無				●	●			●	●	●

(イ) 株式市場リスク

内外の経済動向や株式市場での需給動向等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ロ）債券市場リスク

一般に債券は内外の経済情勢等の影響による金利の変動を受けて価格が変動します。通常、金利が上昇すると債券価格は下落し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、債券の種類や特定の銘柄に関わる格付け等の違い、利払い等の仕組みの違いなどにより、価格の変動度合いが大きくなる場合と小さくなる場合があります。

（ハ）不動産投資信託（リート）に関するリスク

リーツの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値や賃貸収入、個々のリーツの事業活動や財務状況等によっても価格が変動します。これらにより、ファンドが組み入れているリーツの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ニ）金に関するリスク

ファンドは金の指標価格に連動することを目指した上場投資信託証券に投資します。一般に、金価格は、金の需給の変化や為替・金利動向等の様々な要因の影響を受けて変動します。金価格が下落した場合、組入上場投資信託証券の価格も下がり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ホ）信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ヘ）為替変動リスク

（為替ヘッジあり）

外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する（円高となる）場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

原則として対円で為替ヘッジを行うため為替の変動による影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。また、「先進国株インデックスヘッジ有」および「Gリートインデックスヘッジ有」については、一部の通貨建資産について為替ヘッジが困難等と判断された場合、他の通貨で代替した為替取引を行うことまたは為替ヘッジを行わないことがあります。

（限定為替ヘッジ）

外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する（円高となる）場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

「新興国株インデックスヘッジ有」については、外貨建資産とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行います。したがって、米ドル建て資産については、為替の変動による影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。また、実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。

なお、円金利が米ドルの金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。

（為替ヘッジなし）

外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する（円高となる）場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

（ト）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化、取引規制や税制の変更等によって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

(チ)流動性リスク

有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、十分な数量の売買ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

なお、海外の取引所によっては、長期間にわたる個別銘柄の売買停止措置がとられることがあり、そのような場合には一般社団法人投資信託協会規則もしくは委託会社の社内ルールに従って、当該有価証券の評価を行います。

(リ)対象インデックスの動きと連動しない要因

各ファンドは、特定の指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いますが、以下の要因等により、各対象インデックスの動きに連動しないことがあります。

- ・有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること
- ・追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること
- ・インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること
- ・利用可能な指数先物と対象インデックスの動きに不一致が生じること
- ・「ゴールドヘッジ有」および「ゴールドヘッジ無」は、金の指標価格と当該指標との連動を目指した上場投資信託証券の取引価格の動きに不一致が生じること

(ヌ)外国税制に関する留意点

投資対象国によっては、有価証券の売買を行う際の売買益等に対して課税される場合があります。将来、これらの税率や課税方法が変更された場合、または新たな税制が適用された場合、基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(ル)ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(ロ)換金制限等に関する留意点

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

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受け付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

(ワ)収益分配金に関する留意事項

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



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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上が

りが小さかった場合も同様です。

□ 投資リスクの管理体制

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

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

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

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

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

（参考情報）投資リスクの定量的比較

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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

■日本株インデックス（ベンチマーク：TOPIX（東証株価指数、配当込み））



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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



■先進国株インデックスヘッジ有（ベンチマーク：MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ヘッジ換算ベース））



※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。

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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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

■先進国株インデックスヘッジ無（ベンチマーク：MSCIコクサインデックス（配当込み、円ベース））



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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



■新興国株インデックスヘッジ有（ベンチマーク：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース））



■新興国株インデックスヘッジ無（ベンチマーク：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））



※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。

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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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

■日本債インデックス（ベンチマーク：NOMURA-BPI（総合））



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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



■先進国債インデックスヘッジ有（ベンチマーク：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース））



■先進国債インデックスヘッジ無（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））



※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。

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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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

■新興国債インデックスヘッジ有(ベンチマーク：JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ換算ベース))



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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



■新興国債インデックスヘッジ無(ベンチマーク：JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース))



■Jリートインデックス(ベンチマーク：東証REIT指数(配当込み))



※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。

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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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

■Gリートインデックスヘッジ有(ベンチマーク：S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース))



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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



■Gリートインデックスヘッジ無(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))



■ゴールドヘッジ有(ベンチマーク：LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース))



※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。

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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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

■ゴールドヘッジ無（ベンチマーク：LBMA金価格（円換算ベース））



※ファンド設定から1年未満のため、年間騰落率はベンチマークのデータを表示しております。
※分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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



※ファンド設定から1年未満のため、騰落率はベンチマークのデータをもとに計算しております。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3)【信託報酬等】

純資産総額に以下の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の配分は以下の通りです。

< 信託報酬率およびその配分 >

ファンド名	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
日本株インデックス	年0.121% （税抜き0.11%）	年0.06%	年0.03%	年0.02%
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無	年0.121% （税抜き0.11%）	年0.06%	年0.03%	年0.02%
新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無	年0.198% （税抜き0.18%）	年0.13%	年0.03%	年0.02%
日本債インデックス	年0.11% （税抜き0.1%）	年0.055%	年0.025%	年0.02%
先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無	年0.121% （税抜き0.11%）	年0.06%	年0.03%	年0.02%
新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無	年0.198% （税抜き0.18%）	年0.13%	年0.03%	年0.02%
Jリートインデックス	年0.1375% （税抜き0.125%）	年0.075%	年0.03%	年0.02%
Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無	年0.154% （税抜き0.14%）	年0.09%	年0.03%	年0.02%
ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	年0.198% （税抜き0.18%）	年0.13%	年0.03%	年0.02%
マザーファンドが投資対象とする投資信託	年0.25%程度*			
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年0.448%（税抜き0.43%）程度*			
<p>* マザーファンドが投資対象とする投資信託の運用管理費用は、管理費用が最大の投資信託の数値を用いています。なお、管理費用は年度によって異なることや実際の組入状況等により実質的な負担も変動します。</p> <p>また、年間最低報酬額等が定められている場合があるため、純資産総額によっては、上記の料率を上回ることがあります。</p> <p>投資対象とする投資信託の変更等に伴い、実質的な負担が変更となる場合があります。</p>				

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に以下の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、「新興国債インデックスヘッジ有」、「新興国債インデックスヘッジ無」、「ゴールドヘッジ有」および「ゴールドヘッジ無」は各計算期末または信託終了のときに、その他のファンドは毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となる場合があります。

ファンド名	監査料率

日本株インデックス	年0.0055% (税抜き0.005%)以内
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無	年0.0066% (税抜き0.006%)以内
新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無	年0.0077% (税抜き0.007%)以内
日本債インデックス	年0.0044% (税抜き0.004%)以内
先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無	年0.0055% (税抜き0.005%)以内
新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無	年0.0066% (税抜き0.006%)以内
Jリートインデックス	年0.0055% (税抜き0.005%)以内
Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無	年0.0066% (税抜き0.006%)以内
ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	年0.0066% (税抜き0.006%)以内

- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等(それらにかかる消費税等相当額を含みます。)は、信託財産中から支弁するものとします。

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

リートを実質的な主要投資対象とするファンドでは、株式と同様に取引所等の市場で売買される多数の銘柄のリートの中から、約款上の選定基準に従って適宜組入銘柄を選定して分散投資を行い、また売却を行いますので、組み入れるリートの銘柄や構成比は流動的となります。

リートの多くは法人形態をとっており、その費用には、運用者等に支払う費用以外に、一般の会社と同じように多種多様なものがあり、また、国・地域によっては、開示する項目の基準が異なります。

したがって、委託会社において、ファンドが実質的に組み入れる様々なリートの費用等を網羅的に調査し、ファンドへの投資等のための参考になるような情報として、その上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

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

(5)【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

- (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあた

ります。

- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われま
す。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受
取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本
の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から
当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。
（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参
照。）

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

ハ 収益分配金の課税について

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

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



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部
分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配
金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け
取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した
額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および

地方税5%)の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・一部解約時および償還時

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

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

(ロ)法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%(所得税のみ)の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、「日本株インデックス」は、配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。その他のファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2022年7月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

日興FWS・日本株インデックス

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	2,747,962,929	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,218,612	0.04
合計(純資産総額)		2,746,744,317	100.00

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

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	1,205,125,003	98.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	15,414,695	1.26
合計(純資産総額)		1,220,539,698	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	1,205,842,985	98.80

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	4,851,489,447	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,113,793	0.04
合計(純資産総額)		4,849,375,654	100.00

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	783,613,368	98.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	13,434,308	1.69
合計(純資産総額)		797,047,676	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	788,920,139	98.98

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	1,602,655,918	100.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,228,228	0.08
合計(純資産総額)		1,601,427,690	100.00

日興FWS・日本債インデックス

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	4,078,378,137	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,771,367	0.04
合計(純資産総額)		4,076,606,770	100.00

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	695,081,039	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	356,325	0.05
合計(純資産総額)		694,724,714	100.00

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	599,197,026	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	282,036	0.05
合計(純資産総額)		598,914,990	100.00

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	479,843,297	97.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	13,842,861	2.80
合計(純資産総額)		493,686,158	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	471,665,727	95.54

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	892,423,968	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	8,703,904	0.97
合計(純資産総額)		901,127,872	100.00

日興FWS・Jリートインデックス

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	652,789,554	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	337,199	0.05

合計(純資産総額)	652,452,355	100.00
-----------	-------------	--------

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	217,489,003	98.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,670,859	1.21
合計(純資産総額)		220,159,862	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	213,626,069	97.03

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	701,658,235	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	399,492	0.06
合計(純資産総額)		701,258,743	100.00

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	368,668,370	97.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	8,982,147	2.38
合計(純資産総額)		377,650,517	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	18,801,818	4.98
為替予約取引	売建	-	377,970,259	100.08

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	1,662,977,178	99.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	93,392	0.01
合計(純資産総額)		1,663,070,570	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

日興FWS・日本株インデックス

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	国内株式イン デックス・マ ザーファンド (B号)	834,562,192	3.2804	2,737,727,800	3.2927	2,747,962,929	100.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	200,359,946	5.7938	1,160,854,690	6.0148	1,205,125,003	98.74

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.74
合計	98.74

日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	806,591,981	5.8397	4,710,245,341	6.0148	4,851,489,447	100.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	470,384,398	1.6954	797,486,260	1.6659	783,613,368	98.31

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.31
合計	98.31

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	962,036,088	1.7106	1,645,676,278	1.6659	1,602,655,918	100.08

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
----	---------

親投資信託受益証券	100.08
合 計	100.08

日興FWS・日本債インデックス

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券(NO MURA - B P I) マザーファ ンド	2,952,778,843	1.4007	4,135,995,320	1.3812	4,078,378,137	100.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04
合 計	100.04

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	509,964,079	1.4630	746,082,130	1.3630	695,081,039	100.05

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.05
合 計	100.05

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

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

日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	293,292,720	1.9948	585,070,396	2.0430	599,197,026	100.05
----	-------------------	--------------------------	-------------	--------	-------------	--------	-------------	--------

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.05
合計	100.05

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	520,550,334	0.9804	510,371,869	0.9218	479,843,297	97.20

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.20
合計	97.20

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	968,131,882	0.9762	945,094,409	0.9218	892,423,968	99.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.03
合計	99.03

日興FWS・Jリートインデックス

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	238,714,823	2.6736	638,217,775	2.7346	652,789,554	100.05

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.05
合計	100.05

日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イ ンデックス・マ ザーファンド	71,695,732	2.8460	204,048,310	3.0335	217,489,003	98.79

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.79
合計	98.79

日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イ ンデックス・マ ザーファンド	231,303,193	2.8537	660,069,488	3.0335	701,658,235	100.06

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.06
合計	100.06

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 （円）	帳簿価額 （円）	評価額 単価 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	318,586,563	1.0473	333,651,528	1.1572	368,668,370	97.62

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	97.62
合計	97.62

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 （円）	帳簿価額 （円）	評価額 単価 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	1,437,069,805	1.0514	1,510,988,027	1.1572	1,662,977,178	99.99

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

【投資不動産物件】

日興FWS・日本株インデックス

該当事項はありません。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

日興FWS・日本債インデックス

該当事項はありません。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

日興FWS・Jリートインデックス

該当事項はありません。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

日興FWS・日本株インデックス

該当事項はありません。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	6,884,639.34	941,671,545	925,141,997	75.80
	ユーロ	売建	766,782.60	105,781,457	105,223,121	8.62
	イギリス・ポンド	売建	335,014.82	54,618,060	54,828,089	4.49
	カナダ・ドル	売建	427,775.71	45,022,332	44,871,189	3.68
	スイス・フラン	売建	258,991.27	36,234,175	36,535,897	2.99
	オーストラリア・ドル	売建	289,468.50	26,732,080	27,232,066	2.23
	スウェーデン・クローナ	売建	910,427.10	11,776,073	12,010,626	0.98

(注)日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	5,870,915.65	803,020,845	788,920,139	98.98

(注)日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

日興FWS・日本債インデックス

該当事項はありません。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	3,510,000.00	483,071,894	471,665,727	95.54

(注)日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

日興FWS・Jリートインデックス

該当事項はありません。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	1,242,904.12	170,019,790	167,018,595	75.86
	オーストラリア・ドル	売建	145,026.36	13,387,888	13,643,513	6.20
	イギリス・ポンド	売建	71,154.89	11,601,383	11,645,116	5.29
	ユーロ	売建	52,933.49	7,301,538	7,263,893	3.30

シンガポール・ドル	売建	72,402.23	7,052,495	7,051,230	3.20
カナダ・ドル	売建	37,014.30	3,896,278	3,882,584	1.76
香港・ドル	売建	182,155.28	3,179,400	3,121,138	1.42

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約	アメリカ・ドル	買建	140,000.00	19,337,934	18,801,818	4.98
取引	アメリカ・ドル	売建	2,814,400.00	387,275,801	377,970,259	100.08

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

日興FWS・日本株インデックス

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2021年 8月末日	1,010,113	-	10,101	-
9月末日	1,054,043	-	10,540	-
10月末日	438,384,421	-	10,361	-
11月末日	966,308,672	-	9,977	-
12月末日	1,471,901,222	-	10,322	-
2022年 1月末日	1,548,498,439	-	9,821	-
2月末日	1,718,609,367	-	9,775	-
3月末日	1,905,839,354	-	10,194	-
4月末日	1,931,822,556	-	9,949	-
5月末日	2,042,448,473	-	10,023	-
6月末日	2,261,647,827	-	9,817	-
7月末日	2,746,744,317	-	10,181	-

日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
2021年 8月末日	1,024,095	-	10,241	-
9月末日	986,030	-	9,860	-
10月末日	157,238,542	-	10,319	-
11月末日	397,480,514	-	10,343	-
12月末日	746,827,048	-	10,619	-
2022年 1月末日	767,326,428	-	9,872	-
2月末日	826,522,201	-	9,786	-
3月末日	1,001,759,836	-	10,228	-
4月末日	942,107,504	-	9,389	-
5月末日	1,005,814,880	-	9,348	-
6月末日	943,781,144	-	8,576	-
7月末日	1,220,539,698	-	9,041	-

日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
2021年 8月末日	1,027,529	-	10,275	-
9月末日	1,003,594	-	10,036	-
10月末日	613,151,364	-	10,721	-
11月末日	1,643,924,667	-	10,664	-
12月末日	2,408,203,318	-	11,093	-
2022年 1月末日	2,536,932,668	-	10,312	-
2月末日	2,902,810,267	-	10,239	-
3月末日	3,353,922,726	-	11,328	-
4月末日	3,351,051,268	-	10,841	-
5月末日	3,494,794,667	-	10,810	-
6月末日	3,954,555,087	-	10,555	-
7月末日	4,849,375,654	-	10,968	-

日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
2021年 8月末日	1,002,212	-	10,022	-
9月末日	974,592	-	9,746	-
10月末日	115,121,607	-	9,949	-
11月末日	316,607,144	-	9,468	-

12月末日	527,537,051	-	9,465	-
2022年 1月末日	606,368,571	-	9,244	-
2月末日	665,321,808	-	9,144	-
3月末日	740,572,303	-	9,007	-
4月末日	679,662,694	-	8,188	-
5月末日	719,867,316	-	8,294	-
6月末日	704,366,124	-	7,925	-
7月末日	797,047,676	-	7,834	-

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2021年 8月末日	1,007,618	-	10,076	-
9月末日	998,520	-	9,985	-
10月末日	220,641,827	-	10,341	-
11月末日	600,652,022	-	9,848	-
12月末日	893,704,383	-	9,963	-
2022年 1月末日	1,014,549,917	-	9,766	-
2月末日	1,098,190,220	-	9,667	-
3月末日	1,177,579,544	-	10,083	-
4月末日	1,185,077,369	-	9,675	-
5月末日	1,248,979,742	-	9,791	-
6月末日	1,409,269,192	-	10,009	-
7月末日	1,601,427,690	-	9,769	-

日興FWS・日本債インデックス

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2021年 8月末日	998,859	-	9,989	-
9月末日	995,318	-	9,953	-
10月末日	999,196,012	-	9,930	-
11月末日	1,875,741,558	-	9,952	-
12月末日	2,480,389,637	-	9,927	-
2022年 1月末日	2,651,352,496	-	9,856	-
2月末日	2,939,046,709	-	9,805	-
3月末日	3,028,474,572	-	9,776	-
4月末日	3,130,224,805	-	9,751	-
5月末日	3,197,704,450	-	9,735	-
6月末日	3,541,768,418	-	9,643	-
7月末日	4,076,606,770	-	9,707	-

日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
2021年 8月末日	998,341	-	9,983	-
9月末日	982,579	-	9,826	-
10月末日	83,735,106	-	9,790	-
11月末日	263,605,861	-	9,841	-
12月末日	454,335,739	-	9,747	-
2022年 1月末日	493,187,705	-	9,624	-
2月末日	537,718,815	-	9,421	-
3月末日	592,035,578	-	9,166	-
4月末日	581,846,910	-	8,966	-
5月末日	610,698,566	-	8,871	-
6月末日	601,995,810	-	8,629	-
7月末日	694,724,714	-	8,880	-

日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
2021年 8月末日	997,291	-	9,973	-
9月末日	990,491	-	9,905	-
10月末日	114,718,669	-	10,087	-
11月末日	253,457,612	-	9,966	-
12月末日	353,165,417	-	10,023	-
2022年 1月末日	385,588,348	-	9,849	-
2月末日	415,084,555	-	9,670	-
3月末日	439,502,206	-	9,986	-
4月末日	456,916,105	-	10,006	-
5月末日	457,928,412	-	9,945	-
6月末日	517,155,563	-	10,179	-
7月末日	598,914,990	-	10,244	-

日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
2021年 8月末日	502,242,719	-	10,045	-
9月末日	486,236,889	-	9,725	-
10月末日	543,545,108	-	9,752	-
11月末日	636,845,419	-	9,556	-

12月末日	710,593,250	-	9,640	-
2022年 1月末日	652,760,057	-	9,253	-
2月末日	546,225,162	-	8,622	-
3月末日	459,275,888	-	7,978	-
4月末日	436,737,758	-	7,519	-
5月末日	453,235,354	-	7,510	-
6月末日	431,748,658	-	7,030	-
7月末日	493,686,158	-	7,331	-

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2021年 8月末日	1,011,760	-	10,118	-
9月末日	998,210	-	9,982	-
10月末日	169,582,405	-	10,099	-
11月末日	409,377,455	-	9,897	-
12月末日	574,404,695	-	10,097	-
2022年 1月末日	630,397,692	-	9,737	-
2月末日	636,185,656	-	9,080	-
3月末日	647,176,227	-	8,901	-
4月末日	664,357,106	-	8,865	-
5月末日	673,988,080	-	8,829	-
6月末日	761,112,191	-	8,849	-
7月末日	901,127,872	-	9,107	-

日興FWS・Jリートインデックス

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2021年 8月末日	1,002,017	-	10,020	-
9月末日	970,964	-	9,710	-
10月末日	120,686,454	-	9,776	-
11月末日	255,037,898	-	9,368	-
12月末日	379,066,405	-	9,691	-
2022年 1月末日	394,671,416	-	9,166	-
2月末日	419,267,520	-	8,901	-
3月末日	474,332,136	-	9,506	-
4月末日	482,934,462	-	9,394	-
5月末日	508,159,423	-	9,558	-
6月末日	550,874,295	-	9,399	-
7月末日	652,452,355	-	9,687	-

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2021年 8月末日	1,011,314	-	10,113	-
9月末日	973,633	-	9,736	-
10月末日	31,211,949	-	10,315	-
11月末日	82,290,977	-	10,329	-
12月末日	139,603,029	-	10,847	-
2022年 1月末日	152,899,245	-	10,083	-
2月末日	170,109,151	-	10,057	-
3月末日	204,635,556	-	10,650	-
4月末日	200,909,584	-	10,377	-
5月末日	194,441,831	-	9,569	-
6月末日	178,858,063	-	8,770	-
7月末日	220,159,862	-	9,343	-

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2021年 8月末日	1,015,416	-	10,154	-
9月末日	992,176	-	9,922	-
10月末日	110,340,228	-	10,729	-
11月末日	250,046,670	-	10,667	-
12月末日	379,924,154	-	11,356	-
2022年 1月末日	405,983,254	-	10,562	-
2月末日	448,573,117	-	10,567	-
3月末日	515,267,274	-	11,865	-
4月末日	542,956,002	-	12,063	-
5月末日	517,336,196	-	11,162	-
6月末日	565,900,978	-	10,896	-
7月末日	701,258,743	-	11,468	-

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2021年 8月末日	991,735	-	9,917	-
9月末日	936,293	-	9,363	-
10月末日	52,315,743	-	9,613	-
11月末日	139,190,021	-	9,514	-

12月末日	267,312,084	-	9,604	-
2022年 1月末日	280,364,212	-	9,512	-
2月末日	322,512,545	-	10,045	-
3月末日	359,331,084	-	10,243	-
4月末日	351,512,644	-	9,990	-
5月末日	359,826,871	-	9,806	-
6月末日	354,672,223	-	9,600	-
7月末日	377,650,517	-	9,234	-

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2021年 8月末日	996,725	-	9,967	-
9月末日	966,460	-	9,665	-
10月末日	310,067,562	-	10,077	-
11月末日	686,185,433	-	9,979	-
12月末日	952,410,513	-	10,195	-
2022年 1月末日	1,035,843,735	-	10,135	-
2月末日	1,184,029,566	-	10,707	-
3月末日	1,303,926,101	-	11,589	-
4月末日	1,386,995,694	-	11,898	-
5月末日	1,380,453,583	-	11,633	-
6月末日	1,566,826,452	-	12,156	-
7月末日	1,663,070,570	-	11,563	-

【分配の推移】

日興FWS・日本株インデックス

該当事項はありません。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

該当事項はありません。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)
該当事項はありません。

日興FWS・日本債インデックス
該当事項はありません。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)
該当事項はありません。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)
該当事項はありません。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)
該当事項はありません。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)
該当事項はありません。

日興FWS・Jリートインデックス
該当事項はありません。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)
該当事項はありません。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)
該当事項はありません。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)
該当事項はありません。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)
該当事項はありません。

【収益率の推移】

日興FWS・日本株インデックス

	収益率(%)
第1期(中間期)	0.3

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

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期(中間期)	1.3

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

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

	収益率(%)
第1期(中間期)	5.4

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

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期(中間期)	5.3

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

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

	収益率(%)
第1期(中間期)	0.6

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

日興FWS・日本債インデックス

	収益率(%)
第1期(中間期)	1.5

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

日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）

	収益率（％）
第1期（中間期）	4.1

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

日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）

	収益率（％）
第1期（中間期）	1.9

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

日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）

	収益率（％）
第1期（中間期）	7.4

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

日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）

	収益率（％）
第1期（中間期）	3.2

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

日興FWS・Jリートインデックス

	収益率（％）
第1期（中間期）	9.1

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

日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）

	収益率（％）
第1期（中間期）	1.5

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

日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）

	収益率（％）

第1期(中間期)	6.0
----------	-----

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

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期(中間期)	4.3

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

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

	収益率(%)
第1期(中間期)	1.3

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

(4)【設定及び解約の実績】

日興FWS・日本株インデックス

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	1,638,526,438	10,375,117

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	786,974,552	3,155,253

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	2,525,221,866	9,500,059

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	661,717,251	2,342,541

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	1,067,357,217	13,543,108

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・日本債インデックス

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	2,784,639,195	20,244,390

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	518,397,258	2,474,540

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	402,362,519	4,530,864

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	824,913,289	117,754,188

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	664,286,225	7,435,473

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・Jリートインデックス

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	444,126,591	3,126,115

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	153,962,090	1,461,193

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	394,795,364	3,200,481

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	297,873,246	1,674,813

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	1,049,333,759	11,512,722

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	210,362,331,690	98.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,703,115,007	1.27
合計(純資産総額)		213,065,446,697	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,635,000,000	1.24
合計	買建	-	2,635,000,000	1.24

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	274,879,378,703	67.29
	イギリス	16,962,465,908	4.15
	カナダ	15,026,682,279	3.68
	スイス	13,185,433,567	3.23
	フランス	11,753,357,962	2.88

	ドイツ	8,489,303,860	2.08
	オーストラリア	8,103,212,917	1.98
	オランダ	7,115,861,612	1.74
	アイルランド	7,035,156,013	1.72
	スウェーデン	3,783,543,676	0.93
	デンマーク	3,230,432,491	0.79
	スペイン	2,711,287,911	0.66
	香港	2,541,305,574	0.62
	イタリア	1,783,898,583	0.44
	ジャージー	1,460,738,528	0.36
	フィンランド	1,377,191,495	0.34
	シンガポール	1,269,420,189	0.31
	ノルウェー	930,538,050	0.23
	ベルギー	904,841,600	0.22
	ケイマン諸島	901,850,710	0.22
	イスラエル	888,075,078	0.22
	バミューダ	521,200,351	0.13
	オランダ領キュ ラソー	407,670,341	0.10
	ニュージーラン ド	272,598,891	0.07
	ルクセンブルグ	266,031,362	0.07
	ポルトガル	216,738,176	0.05
	オーストリア	192,596,129	0.05
	リベリア	60,595,418	0.01
	パナマ	58,988,740	0.01
	マン島	57,555,444	0.01
	小計	386,387,951,558	94.59
投資証券	アメリカ	8,775,216,510	2.15
	オーストラリア	869,146,846	0.21
	イギリス	222,594,235	0.05
	香港	213,383,815	0.05
	シンガポール	168,452,567	0.04
	フランス	153,753,898	0.04
	ベルギー	42,912,038	0.01
	カナダ	35,797,307	0.01
	小計	10,481,257,216	2.57
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	11,635,125,694	2.84
合計（純資産総額）		408,504,334,468	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 （%）
株価指数先物取引	買建	イギリス	549,940,377	0.13
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,701,872,550	0.42
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,212,008,428	2.26
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	415,812,930	0.10

合計	買建	-	11,879,634,285	2.91
----	----	---	----------------	------

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	-	1,893,041,485	0.46

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン諸島	3,443,707,195	14.93
	台湾	2,613,905,563	11.33
	インド	2,517,058,213	10.91
	韓国	2,191,139,821	9.50
	中国	1,297,342,140	5.63
	ブラジル	911,305,198	3.95
	南アフリカ	637,169,338	2.76
	インドネシア	346,777,936	1.50
	タイ	343,016,272	1.49
	メキシコ	306,415,070	1.33
	マレーシア	274,005,729	1.19
	香港	222,998,366	0.97
	フィリピン	133,915,694	0.58
	バミューダ	108,787,319	0.47
	チリ	100,832,480	0.44
	ポーランド	100,260,045	0.43
	アメリカ	68,116,892	0.30
	トルコ	49,485,199	0.21
	ギリシャ	47,056,889	0.20
	チェコ	29,166,882	0.13
	コロンビア	27,088,602	0.12
	ハンガリー	25,667,976	0.11
	ルクセンブルグ	18,180,580	0.08
	エジプト	12,255,985	0.05
シンガポール	4,030,678	0.02	
ペルー	3,061,047	0.01	
小計		15,832,747,109	68.65
投資信託受益証券	香港	1,006,594,373	4.36
投資証券	アメリカ	1,415,837,577	6.14
	メキシコ	82,086,682	0.36
	ブラジル	31,565,214	0.14
	南アフリカ	8,016,355	0.03
	小計	1,537,505,828	6.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	4,685,049,690	20.32
合計(純資産総額)		23,061,897,000	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,746,682,432	20.58
合計	買建	-	4,746,682,432	20.58

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	-	166,408,965	0.72

国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	97,065,046,050	77.33
地方債証券	日本	11,819,810,950	9.42
特殊債券	日本	9,568,783,195	7.62
社債券	日本	6,318,244,300	5.03
	フランス	99,949,000	0.08
	小計	6,418,193,300	5.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	645,831,879	0.52
合計(純資産総額)		125,517,665,374	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	11,789,102,676	49.22
	フランス	2,055,596,859	8.58
	イタリア	1,810,229,956	7.56
	ドイツ	1,530,824,559	6.39
	スペイン	1,229,872,229	5.13
	イギリス	1,184,274,718	4.94
	中国	525,641,908	2.19
	カナダ	488,318,707	2.04
	ベルギー	462,887,847	1.93
	オランダ	403,601,783	1.68
	オーストラリア	362,405,618	1.51
	オーストリア	301,396,786	1.26
	シンガポール	220,903,683	0.92
	メキシコ	178,213,754	0.74
	アイルランド	157,372,524	0.66
	フィンランド	128,364,036	0.54
	ポーランド	97,446,392	0.41
	イスラエル	91,804,039	0.38
	デンマーク	88,403,323	0.37
	スウェーデン	62,238,621	0.26
ノルウェー	48,567,234	0.20	

	小計	23,217,467,252	96.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	736,138,109	3.07
合計(純資産総額)		23,953,605,361	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	22,824,488,437	95.29

外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	80,032,490,658	50.26
	フランス	13,973,722,679	8.78
	イタリア	12,413,085,306	7.80
	ドイツ	10,430,978,108	6.55
	スペイン	8,267,262,122	5.19
	イギリス	8,011,018,722	5.03
	中国	3,574,705,306	2.24
	カナダ	3,301,964,567	2.07
	ベルギー	3,060,041,316	1.92
	オランダ	2,739,115,818	1.72
	オーストラリア	2,467,905,670	1.55
	オーストリア	2,025,760,109	1.27
	メキシコ	1,214,114,734	0.76
	アイルランド	1,152,442,134	0.72
	マレーシア	799,122,509	0.50
	フィンランド	786,830,094	0.49
	シンガポール	701,867,712	0.44
	ポーランド	649,754,677	0.41
	イスラエル	645,387,766	0.41
	デンマーク	601,762,035	0.38
スウェーデン	426,397,290	0.27	
ノルウェー	332,623,857	0.21	
小計		157,608,353,189	98.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,624,900,897	1.02
合計(純資産総額)		159,233,254,086	100.00

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	サウジアラビア	165,856,480	10.04
	メキシコ	161,857,756	9.80
	カタール	151,393,713	9.16

	アラブ首長国連邦	129,371,921	7.83	
	ブラジル	103,348,308	6.25	
	コロンビア	101,051,727	6.12	
	トルコ	100,429,155	6.08	
	南アフリカ	100,024,383	6.05	
	チリ	97,450,371	5.90	
	オマーン	79,406,708	4.81	
	インドネシア	75,982,768	4.60	
	フィリピン	66,877,478	4.05	
	パナマ	64,449,652	3.90	
	ドミニカ共和国	60,229,225	3.64	
	ペルー	52,689,853	3.19	
	中国	49,230,915	2.98	
	ウルグアイ	28,174,142	1.70	
	小計	1,587,824,555	96.09	
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	64,618,367	3.91
	合計(純資産総額)	1,652,442,922	100.00	

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	16,149,720	0.98

Jリート・インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	9,631,665,050	98.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	114,022,333	1.17
合計(純資産総額)		9,745,687,383	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
リート指数先物取引	買建	日本	40,200,000	0.41
合計	買建	-	40,200,000	0.41

外国リート・インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	18,818,072,958	76.39
	オーストラリア	1,545,666,329	6.27
	イギリス	1,243,254,630	5.05
	シンガポール	867,746,576	3.52
	カナダ	439,998,904	1.79
	フランス	376,432,410	1.53
	香港	358,032,575	1.45

	ベルギー	274,991,199	1.12
	スペイン	91,415,866	0.37
	ニュージーランド	82,628,530	0.34
	韓国	52,492,588	0.21
	オランダ	42,511,131	0.17
	ガーンジィ	36,084,677	0.15
	イスラエル	26,705,653	0.11
	ドイツ	15,770,848	0.06
	アイルランド	9,858,447	0.04
	イタリア	6,667,323	0.03
	小計	24,288,330,644	98.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	344,309,205	1.40
合計(純資産総額)		24,632,639,849	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	60,343,083	0.24
為替予約取引	売建	-	3,046,161	0.01

ゴールド・インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

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	2,229,894,769	100.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,490,128	0.07
合計(純資産総額)		2,228,404,641	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	37,278,937	1.67

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3,862,800	2,008.83	7,759,697,451	2,137.00	8,254,803,600	3.87
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	530,800	13,564.73	7,200,159,480	11,695.00	6,207,706,000	2.91
日本	株式	キーエンス	電気機器	76,800	68,097.27	5,229,870,412	52,430.00	4,026,624,000	1.89
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャルG	銀行業	4,887,500	609.25	2,977,694,889	745.40	3,643,142,500	1.71

日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	931,900	3,253.46	3,031,901,185	3,807.00	3,547,743,300	1.67
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	580,000	6,788.77	3,937,484,191	4,953.00	2,872,740,000	1.35
日本	株式	任天堂	その他製品	47,800	51,145.61	2,444,760,286	59,710.00	2,854,138,000	1.34
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	498,800	5,919.53	2,952,659,801	5,605.00	2,795,774,000	1.31
日本	株式	日立	電気機器	407,500	6,650.55	2,710,099,622	6,704.00	2,731,880,000	1.28
日本	株式	武田薬品	医薬品	666,100	3,110.39	2,071,829,350	3,925.00	2,614,442,500	1.23
日本	株式	KDDI	情報・通信業	606,300	3,418.12	2,072,405,679	4,292.00	2,602,239,600	1.22
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	53,800	58,945.50	3,171,268,024	46,010.00	2,475,338,000	1.16
日本	株式	信越化学	化学	131,500	18,945.01	2,491,268,762	16,960.00	2,230,240,000	1.05
日本	株式	三井住友フィナンシャルG	銀行業	541,500	3,729.37	2,019,451,660	4,107.00	2,223,940,500	1.04
日本	株式	HOYA	精密機器	163,600	17,467.54	2,857,689,846	13,270.00	2,170,972,000	1.02
日本	株式	第一三共	医薬品	614,600	2,831.65	1,740,333,298	3,523.00	2,165,235,800	1.02
日本	株式	三菱商事	卸売業	547,200	3,427.61	1,875,586,764	3,948.00	2,160,345,600	1.01
日本	株式	ダイキン工業	機械	92,500	23,169.87	2,143,212,991	23,250.00	2,150,625,000	1.01
日本	株式	本田技研	輸送用機器	619,400	3,116.26	1,930,211,798	3,388.00	2,098,527,200	0.98
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,260,000	1,553.41	1,957,298,079	1,538.50	1,938,510,000	0.91
日本	株式	伊藤忠	卸売業	499,900	3,289.00	1,644,171,903	3,866.00	1,932,613,400	0.91
日本	株式	東京海上HD	保険業	232,400	5,791.21	1,345,878,058	7,764.00	1,804,353,600	0.85
日本	株式	村田製作所	電気機器	231,100	8,372.89	1,934,973,836	7,747.00	1,790,331,700	0.84
日本	株式	三井物産	卸売業	604,800	2,583.79	1,562,676,851	2,925.50	1,769,342,400	0.83
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	86,100	17,962.61	1,546,580,634	20,150.00	1,734,915,000	0.81
日本	株式	日本電産	電気機器	188,300	12,840.40	2,417,846,380	9,198.00	1,731,983,400	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	74,400	22,162.10	1,648,860,368	22,825.00	1,698,180,000	0.80
日本	株式	SMC	機械	24,800	71,687.49	1,777,849,629	65,410.00	1,622,168,000	0.76
日本	株式	みずほフィナンシャルG	銀行業	1,000,200	1,412.30	1,412,584,930	1,583.50	1,583,816,700	0.74
日本	株式	セブン&アイ・HLDGS	小売業	279,900	4,602.03	1,288,108,076	5,429.00	1,519,577,100	0.71

□ 種類別・業種別投資比率

2022年7月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.10
	鉱業	0.30
	建設業	2.18
	食料品	3.33
	繊維製品	0.45
	パルプ・紙	0.18
	化学	6.14

医薬品	5.27
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	0.76
非鉄金属	0.70
金属製品	0.61
機械	5.25
電気機器	17.46
輸送用機器	7.76
精密機器	2.75
その他製品	2.47
電気・ガス業	1.28
陸運業	3.00
海運業	0.68
空運業	0.41
倉庫・運輸関連業	0.16
情報・通信業	9.12
卸売業	5.35
小売業	4.32
銀行業	5.24
証券、商品先物取引業	0.72
保険業	2.19
その他金融業	1.16
不動産業	1.98
サービス業	5.49
合計	98.73

外国株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	979,864	21,527.60	21,094,121,428	21,180.88	20,754,385,229	5.08
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	427,708	44,382.02	18,982,545,566	37,207.55	15,913,966,838	3.90
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	550,361	23,196.19	12,766,278,660	16,460.11	9,059,003,039	2.22

アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	52,832	146,350.86	7,732,008,746	113,435.85	5,993,042,668	1.47
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	361,721	19,217.94	6,951,532,110	15,375.15	5,561,516,152	1.36
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	341,697	19,319.96	6,601,571,243	15,424.96	5,270,662,522	1.29
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	56,622	61,787.90	3,498,554,409	72,889.97	4,127,175,819	1.01
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	158,257	21,768.29	3,444,983,832	23,449.06	3,710,978,204	0.91
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	150,539	42,731.50	6,432,756,652	24,208.26	3,644,287,613	0.89
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	255,020	8,783.07	2,239,857,838	12,470.27	3,180,168,357	0.78
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	77,785	38,508.06	2,995,349,181	39,561.88	3,077,320,758	0.75
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	139,063	43,637.46	6,068,356,534	21,634.52	3,008,561,143	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	144,426	20,050.49	2,895,811,629	19,930.36	2,878,461,682	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	99,922	26,764.18	2,674,330,662	28,449.82	2,842,763,263	0.70
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	169,634	16,882.22	2,863,798,701	16,505.19	2,799,841,400	0.69
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	177,940	21,125.23	3,759,022,823	15,454.57	2,749,986,915	0.67
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	62,948	52,971.19	3,334,430,685	40,333.19	2,538,893,914	0.62

アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフト ウェ ア・ サービ ス	52,625	43,998.67	2,315,430,140	47,443.29	2,496,703,373	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネル ギー	117,467	16,374.94	1,923,514,506	20,244.00	2,378,001,701	0.58
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬 品・バ イオテ クノロ ジー・ ライフ サイエ ンス	339,093	7,049.56	2,390,455,981	6,827.42	2,315,130,058	0.57
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬 品・バ イオテ クノロ ジー・ ライフ サイエ ンス	48,836	35,165.88	1,717,360,708	44,528.99	2,174,617,657	0.53
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	106,698	16,308.12	1,740,043,447	20,157.85	2,150,802,012	0.53
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・ 飲料・ タバコ	248,510	7,489.36	1,861,180,207	8,623.12	2,142,930,706	0.52
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	438,418	6,001.16	2,631,016,434	4,485.21	1,966,394,693	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・ 飲料・ タバコ	83,515	22,167.41	1,851,311,608	23,535.21	1,965,543,263	0.48
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬 品・バ イオテ クノロ ジー・ ライフ サイエ ンス	42,408	50,114.49	2,125,255,308	45,741.95	1,939,824,509	0.47
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・ 生活必 需品小 売り	26,771	73,904.03	1,978,484,689	72,175.19	1,932,202,006	0.47

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	23,475	86,025.71	2,019,453,491	80,448.32	1,888,524,321	0.46
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬 品・バ イオテ クノロ ジー・ ライフ サイエ ンス	152,589	10,308.31	1,572,935,102	12,106.82	1,847,368,075	0.45
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導 体・半 導体製 造装置	24,565	94,084.42	2,311,183,868	74,856.15	1,838,841,324	0.45

□ 種類別・業種別投資比率

2022年7月29日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	4.94
	素材	3.97
	資本財	5.85
	商業・専門サービス	1.18
	運輸	1.86
	自動車・自動車部品	2.24
	耐久消費財・アパレル	1.60
	消費者サービス	1.72
	小売	4.71
	食品・生活必需品小売り	1.53
	食品・飲料・タバコ	4.21
	家庭用品・パーソナル用品	1.77
	ヘルスケア機器・サービス	4.75
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.83
	銀行	5.52
	各種金融	4.52
	保険	2.94
	不動産	0.35
	ソフトウェア・サービス	10.90
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.51
半導体・半導体製造装置	4.53	
電気通信サービス	1.48	
公益事業	3.15	
メディア・娯楽	5.51	

投資証券	-	2.57
合計		97.15

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	517,000	2,652.53	1,371,358,155	2,251.29	1,163,918,791	5.05
香港	投資信 託受益 証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	1,170,200	957.2716	1,120,199,172	860.1900	1,006,594,373	4.36
アメリ カ	投資証 券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	139,892	5,558.49	777,588,474	5,877.07	822,155,440	3.56
ケイマ ン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディ ア・娯楽	131,200	7,377.98	967,991,442	5,501.72	721,825,664	3.13
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	100,372	7,435.47	746,313,180	6,431.41	645,533,484	2.80
ケイマ ン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	318,200	2,118.04	673,959,291	1,700.42	541,074,439	2.35
ケイマ ン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	85,800	3,965.39	340,230,586	3,224.20	276,636,360	1.20
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネル ギー	63,892	4,206.16	268,740,004	4,177.07	266,881,356	1.16
アメリ カ	投資証 券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	112,274	2,238.47	251,322,349	2,196.84	246,647,475	1.07
アメリ カ	投資証 券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	65,006	2,810.82	182,720,285	2,976.23	193,472,618	0.84
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフト ウェア・ サービス	70,622	2,852.32	201,436,267	2,579.58	182,175,098	0.79
ケイマ ン諸島	株式	JD.COM INC - CL A	小売	42,085	5,437.82	228,850,843	4,201.75	176,830,648	0.77
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,018,000	89.79	181,188,716	85.92	173,389,587	0.75
ブラジ ル	株式	VALE SA	素材	84,388	1,926.86	162,603,945	1,834.27	154,790,477	0.67
アメリ カ	投資証 券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	30,716	4,756.50	146,100,799	4,999.42	153,562,043	0.67
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	108,637	1,233.37	133,989,588	1,384.82	150,442,690	0.65
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	36,362	4,483.56	163,031,132	3,973.84	144,496,588	0.63

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	261,800	470.74	123,239,397	487.56	127,642,056	0.55
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・ 半導体製 造装置	11,544	11,988.05	138,390,033	10,327.66	119,222,507	0.52
ケイマ ン諸島	株式	NETEASE INC	メディ ア・娯楽	43,500	2,970.14	129,200,942	2,589.65	112,649,775	0.49
ケイマ ン諸島	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディ ア・娯楽	46,800	2,553.06	119,483,152	2,376.99	111,243,132	0.48
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	134,000	944.85	126,609,713	820.63	109,964,085	0.48
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフト ウェア・ サービス	19,410	5,951.31	115,514,995	5,542.85	107,586,718	0.47
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS- PREF	テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	17,420	6,745.29	117,502,926	5,922.30	103,166,466	0.45
ケイマ ン諸島	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	76,000	1,664.99	126,539,178	1,319.69	100,296,630	0.43
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・ 半導体製 造装置	32,000	4,507.84	144,250,729	3,064.64	98,068,326	0.43
南アフ リカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	4,570	19,002.54	86,841,618	20,040.93	91,587,056	0.40
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・ 自動車部 品	17,500	4,997.02	87,447,820	4,959.78	86,796,150	0.38
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,184,000	73.19	86,661,686	71.00	84,065,184	0.36
ブラジ ル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	エネル ギー	99,900	778.53	77,775,405	837.86	83,702,628	0.36

□ 種類別・業種別投資比率

2022年7月29日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	エネルギー	3.44
	素材	5.26
	資本財	2.13
	商業・専門サービス	0.05
	運輸	1.52
	自動車・自動車部品	2.91

	耐久消費財・アパレル	1.19
	消費者サービス	0.88
	小売	5.93
	食品・生活必需品小売り	1.01
	食品・飲料・タバコ	2.25
	家庭用品・パーソナル用品	0.72
	ヘルスケア機器・サービス	0.54
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.21
	銀行	9.06
	各種金融	1.67
	保険	1.94
	不動産	1.20
	ソフトウェア・サービス	2.01
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.27
	半導体・半導体製造装置	7.01
	電気通信サービス	1.90
	公益事業	2.11
	メディア・娯楽	5.43
投資信託受益証券	-	4.36
投資証券	-	6.67
合計		79.68

国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年7月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	435 2年国債	5,940,000,000	100.13	5,947,900,200	100.19	5,951,345,400	0.005	2024/04/01	4.74
日本	国債 証券	149 5年国債	1,500,000,000	99.87	1,498,080,000	100.31	1,504,665,000	0.005	2026/09/20	1.20
日本	国債 証券	360 10年国債	1,470,000,000	98.71	1,450,992,900	100.00	1,470,000,000	0.100	2030/09/20	1.17
日本	国債 証券	146 5年国債	1,280,000,000	100.38	1,284,915,200	100.65	1,288,256,000	0.100	2025/12/20	1.03
日本	国債 証券	150 5年国債	1,270,000,000	99.79	1,267,333,000	100.22	1,273,619,500	0.005	2026/12/20	1.01
日本	国債 証券	144 5年国債	1,220,000,000	100.39	1,224,745,800	100.56	1,226,880,800	0.100	2025/06/20	0.98
日本	国債 証券	357 10年国債	1,210,000,000	98.86	1,196,193,900	100.26	1,213,109,700	0.100	2029/12/20	0.97
日本	国債 証券	361 10年国債	1,200,000,000	98.67	1,184,028,000	99.92	1,198,992,000	0.100	2030/12/20	0.96

日本	国債証券	358 10年国債	1,180,000,000	98.79	1,165,663,000	100.19	1,182,230,200	0.100	2030/03/20	0.94
日本	国債証券	344 10年国債	1,150,000,000	100.28	1,153,162,500	100.71	1,158,107,500	0.100	2026/09/20	0.92
日本	国債証券	365 10年国債	1,150,000,000	98.79	1,136,096,500	99.63	1,145,733,500	0.100	2031/12/20	0.91
日本	国債証券	141 5年国債	1,090,000,000	100.35	1,093,804,100	100.43	1,094,665,200	0.100	2024/09/20	0.87
日本	国債証券	362 10年国債	1,080,000,000	98.59	1,064,761,200	99.83	1,078,153,200	0.100	2031/03/20	0.86
日本	国債証券	359 10年国債	1,060,000,000	98.91	1,048,440,700	100.08	1,060,826,800	0.100	2030/06/20	0.85
日本	国債証券	356 10年国債	1,005,000,000	99.07	995,683,650	100.43	1,009,291,350	0.100	2029/09/20	0.80
日本	国債証券	363 10年国債	910,000,000	98.51	896,404,600	99.74	907,597,600	0.100	2031/06/20	0.72
日本	国債証券	342 10年国債	900,000,000	100.36	903,195,000	100.67	906,066,000	0.100	2026/03/20	0.72
日本	国債証券	340 10年国債	883,000,000	101.37	895,052,950	101.56	896,748,310	0.400	2025/09/20	0.71
日本	国債証券	145 5年国債	890,000,000	100.39	893,475,000	100.61	895,455,700	0.100	2025/09/20	0.71
日本	国債証券	367 10年国債	890,000,000	100.04	890,324,000	100.24	892,153,800	0.200	2032/06/20	0.71
日本	国債証券	355 10年国債	840,000,000	99.24	833,624,400	100.48	844,032,000	0.100	2029/06/20	0.67
日本	国債証券	148 5年国債	820,000,000	100.05	820,391,600	100.33	822,714,200	0.005	2026/06/20	0.66
日本	国債証券	438 2年国債	820,000,000	100.13	821,090,600	100.19	821,566,200	0.005	2024/07/01	0.65
日本	国債証券	147 5年国債	790,000,000	100.00	790,000,000	100.33	792,583,300	0.005	2026/03/20	0.63
日本	特殊債券	37 道路機構	700,000,000	112.57	788,022,900	113.10	791,711,200	2.420	2028/06/20	0.63
日本	国債証券	364 10年国債	750,000,000	98.73	740,497,500	99.68	747,630,000	0.100	2031/09/20	0.60
日本	国債証券	150 20年国債	665,000,000	111.03	738,336,200	112.36	747,160,750	1.400	2034/09/20	0.60

日本	国債証券	345 10年国債	725,000,000	100.22	726,624,000	100.70	730,096,750	0.100	2026/12/20	0.58
日本	国債証券	155 20年国債	680,000,000	105.72	718,896,000	107.28	729,517,600	1.000	2035/12/20	0.58
日本	国債証券	140 5年国債	640,000,000	100.33	642,105,600	100.38	642,412,800	0.100	2024/06/20	0.51

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	77.33
地方債証券	9.42
特殊債券	7.62
社債券	5.11
合計	99.49

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年7月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,090,000	13,024.46	141,966,611	13,021.36	141,932,864	0.125	2023/10/15	0.59
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000	2,011.59	140,811,054	2,017.18	141,202,566	2.910	2028/10/14	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,050,000	13,270.59	139,341,190	12,896.18	135,409,852	0.125	2024/02/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	12,865.34	141,518,761	11,702.59	128,728,485	0.875	2030/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	980,000	13,283.27	130,176,073	13,053.94	127,928,605	0.750	2023/12/31	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	980,000	13,012.04	127,517,963	12,553.32	123,022,582	1.875	2032/02/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,010,000	12,495.66	126,206,171	12,029.69	121,499,887	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	14,238.69	128,148,193	13,448.35	121,035,119	2.875	2023/11/30	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	14,193.99	127,745,941	13,434.62	120,911,547	2.750	2023/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	13,442.07	120,978,634	13,368.39	120,315,494	2.500	2024/05/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	990,000	13,195.93	130,639,667	11,946.64	118,271,711	1.250	2031/08/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	13,300.04	119,700,366	13,053.94	117,485,454	0.875	2024/01/31	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	940,000	12,569.25	118,150,925	12,409.29	116,647,345	0.500	2026/02/28	0.49

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	930,000	13,304.81	123,734,771	12,379.81	115,132,256	1.625	2031/05/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	13,233.64	117,779,434	12,891.47	114,734,039	0.250	2024/03/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	12,847.64	109,204,941	12,795.22	108,759,360	1.875	2029/02/28	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	910,000	12,924.17	117,609,903	11,910.83	108,388,564	1.125	2031/02/15	0.45
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000	2,023.90	101,195,155	2,024.22	101,210,908	3.020	2031/05/27	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	870,000	12,602.18	109,638,967	11,534.33	100,348,645	0.625	2030/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	750,000	13,678.18	102,586,359	13,248.45	99,363,381	1.625	2023/10/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	750,000	13,431.03	100,732,712	13,071.84	98,038,818	0.125	2023/08/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	750,000	14,162.44	106,218,332	13,023.52	97,676,381	1.875	2026/06/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	780,000	13,078.19	102,009,907	11,993.89	93,552,307	0.500	2027/10/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	13,123.95	95,804,828	12,631.67	92,211,174	1.250	2026/12/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	790,000	12,588.27	99,447,368	11,486.94	90,746,860	0.625	2030/08/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	13,151.82	96,008,260	12,388.29	90,434,538	1.250	2028/04/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	720,000	13,459.38	96,907,569	12,511.33	90,081,550	0.750	2026/03/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	660,000	15,104.19	99,687,643	13,552.40	89,445,841	2.875	2028/08/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	700,000	12,740.63	89,184,382	12,768.97	89,382,789	0.375	2024/09/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	720,000	13,083.20	94,199,026	12,412.39	89,369,194	1.375	2028/12/31	0.37

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	96.93
合計	96.93

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 （円）	帳簿価額 （円）	評価額 単価 （円）	評価額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,950,000	13,728.07	2,052,345,902	12,911.39	1,930,252,411	1.625	2026/05/15	1.21

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,300,000	14,087.74	1,873,669,973	13,211.70	1,757,156,403	2.250	2026/03/31	1.10
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	14,757.56	1,328,180,716	13,546.07	1,219,146,616	2.875	2028/05/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	14,222.35	1,208,900,103	13,325.31	1,132,651,615	2.500	2026/02/28	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	13,365.70	1,069,255,689	13,071.84	1,045,747,399	0.125	2023/08/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	13,161.22	1,118,704,000	11,910.83	1,012,420,655	1.125	2031/02/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,700,000	13,301.08	1,024,183,415	12,896.18	993,005,585	0.125	2024/02/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,100,000	13,595.61	965,288,310	12,744.74	904,876,553	1.375	2026/08/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	12,945.58	932,081,638	12,030.77	866,215,350	0.625	2027/12/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,500,000	12,669.09	950,181,702	11,534.33	865,074,530	0.625	2030/05/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	13,883.14	902,403,902	13,286.41	863,616,703	2.125	2024/03/31	0.54
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	41,000,000	2,004.97	822,037,591	2,007.55	823,094,982	2.690	2026/08/12	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,893.08	902,515,628	11,702.59	819,181,269	0.875	2030/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,200,000	13,782.72	854,528,509	13,181.68	817,264,423	1.750	2024/06/30	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,641.76	884,923,447	11,486.94	804,086,104	0.625	2030/08/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,419.70	764,922,817	13,684.99	780,044,489	2.875	2032/05/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	14,017.21	798,980,885	13,368.39	761,998,134	2.500	2024/05/15	0.48
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000	14,235.16	825,639,178	13,044.10	756,557,959	0.000	2030/08/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	14,010.48	784,586,769	13,322.08	746,036,618	2.375	2024/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	13,490.34	809,420,698	12,410.37	744,622,137	1.375	2028/10/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,345.77	760,709,108	13,021.36	742,217,733	0.125	2023/10/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,696.57	753,311,212	13,066.59	718,662,598	1.500	2024/10/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	13,181.15	777,687,602	12,166.32	717,812,940	1.000	2028/07/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	13,031.86	768,879,935	12,091.75	713,413,077	0.750	2028/01/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	14,055.57	716,834,190	13,426.27	684,739,801	2.750	2024/02/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,319.58	732,576,864	12,379.81	680,889,686	1.625	2031/05/15	0.43

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,985.71	713,271,198	13,281.16	677,339,213	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,894.17	694,708,749	13,400.96	670,048,197	2.500	2023/08/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,200,000	13,408.37	697,235,109	12,829.95	667,157,312	0.750	2024/11/15	0.42
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,800,000	13,921.27	668,220,840	13,675.32	656,415,144	0.000	2024/03/25	0.41

ロ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.98
合計	98.98

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年7月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,400,000	11,667.21	163,340,889	11,846.89	165,856,480	2.250	2033/02/02	10.04
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	1,100,000	13,754.82	151,302,986	13,763.06	151,393,713	3.750	2030/04/16	9.16
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,000,000	12,603.45	126,034,532	11,489.23	114,892,327	2.659	2031/05/24	6.95
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	800,000	11,803.28	94,426,222	11,975.85	95,806,782	1.875	2031/09/15	5.80
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	600,000	13,127.21	78,763,272	13,234.45	79,406,708	6.250	2031/01/25	4.81
パナマ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	600,000	12,814.42	76,886,539	10,741.61	64,449,652	2.252	2032/09/29	3.90
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	500,000	11,508.48	57,542,409	12,045.85	60,229,225	6.000	2033/02/22	3.64
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	500,000	13,032.40	65,162,008	12,008.42	60,042,117	3.875	2030/06/12	3.63
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	500,000	11,398.07	56,990,374	10,527.98	52,639,913	6.125	2028/10/24	3.19
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000	15,203.39	60,813,567	12,853.77	51,415,097	5.875	2030/06/22	3.11
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	400,000	12,215.86	48,863,430	12,261.49	49,045,961	4.340	2042/03/07	2.97

南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000	12,992.22	51,968,882	12,152.32	48,609,286	4.850	2029/09/30	2.94
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	400,000	13,715.21	54,860,843	11,947.31	47,789,242	6.375	2025/10/14	2.89
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	400,000	15,493.61	61,974,444	11,741.36	46,965,429	5.000	2051/04/27	2.84
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000	12,697.09	50,788,353	10,556.79	42,227,157	3.125	2031/04/15	2.56
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000	13,746.64	54,986,569	9,759.23	39,036,900	5.000	2045/06/15	2.36
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	300,000	11,155.80	33,467,411	11,188.38	33,565,138	3.125	2049/09/30	2.03
ペルー	国債証券	REPUBLIC OF PERU	200,000	18,481.95	36,963,906	14,581.22	29,162,448	5.625	2050/11/18	1.76
ウルグアイ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	200,000	13,959.06	27,918,114	14,087.07	28,174,142	4.375	2031/01/23	1.70
インドネシア	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	200,000	15,085.34	30,170,677	13,790.12	27,580,242	4.750	2026/01/08	1.67
インドネシア	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	200,000	16,434.53	32,869,069	13,431.12	26,862,233	5.125	2045/01/15	1.63
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	200,000	12,754.30	25,508,595	12,808.95	25,617,898	2.750	2027/01/31	1.55
中国	国債証券	CHINA GOVT INTL BOND	200,000	12,323.81	24,647,629	12,691.17	25,382,330	1.250	2026/10/26	1.54
フィリピン	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000	14,794.85	29,589,700	11,943.14	23,886,275	3.700	2042/02/02	1.45
中国	国債証券	CHINA (PEOPLE'S)	200,000	11,759.13	23,518,251	11,924.29	23,848,584	1.200	2030/10/21	1.44
ペルー	国債証券	REPUBLIC OF PERU	200,000	13,703.30	27,406,596	11,763.70	23,527,405	2.783	2031/01/23	1.42
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000	13,729.55	27,459,093	11,643.36	23,286,722	5.625	2041/01/07	1.41
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	200,000	11,334.16	22,668,324	11,393.26	22,786,511	2.550	2033/07/27	1.38
フィリピン	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	200,000	12,815.81	25,631,628	11,237.92	22,475,831	1.648	2031/06/10	1.36
インドネシア	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	200,000	13,386.96	26,773,929	10,770.15	21,540,292	3.050	2051/03/12	1.30

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	96.09
合計	96.09

Jリート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年7月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド	1,001	662,126.45	662,788,580	706,000.00	706,706,000	7.25
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト	857	614,189.65	526,360,533	643,000.00	551,051,000	5.65
日本	投資証券	日本プロロジスリート	1,406	339,112.36	476,791,979	346,000.00	486,476,000	4.99
日本	投資証券	日本都市ファンド	4,329	94,872.84	410,704,535	108,400.00	469,263,600	4.82
日本	投資証券	GLP投資法人	2,643	169,922.74	449,105,789	175,100.00	462,789,300	4.75
日本	投資証券	野村不動産マスターF	2,775	153,618.24	426,290,604	166,700.00	462,592,500	4.75
日本	投資証券	大和ハウスリート	1,292	311,695.67	402,710,809	320,500.00	414,086,000	4.25
日本	投資証券	オリックス不動産投資	1,710	162,688.20	278,196,825	191,100.00	326,781,000	3.35
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス	858	326,635.86	280,253,568	367,000.00	314,886,000	3.23
日本	投資証券	ユナイテッドアーバン投資	1,932	133,208.08	257,358,001	145,000.00	280,140,000	2.87
日本	投資証券	日本プライムリアルティ	586	377,209.63	221,044,846	406,500.00	238,209,000	2.44
日本	投資証券	産業ファンド	1,283	172,675.27	221,542,368	185,100.00	237,483,300	2.44
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資	2,610	76,594.94	199,912,792	83,400.00	217,674,000	2.23
日本	投資証券	日本アコモデーションF	297	611,870.99	181,725,684	696,000.00	206,712,000	2.12
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート	2,766	59,357.87	164,183,856	69,000.00	190,854,000	1.96
日本	投資証券	API投資法人	453	393,021.24	178,038,622	417,500.00	189,127,500	1.94
日本	投資証券	日本ロジスティクスF	579	303,090.34	175,489,305	320,000.00	185,280,000	1.90
日本	投資証券	ラサールロジポート投資	1,051	167,531.77	176,075,886	175,600.00	184,555,600	1.89
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資	252	675,302.94	170,176,340	715,000.00	180,180,000	1.85
日本	投資証券	三井不ロジパーク	338	531,238.62	179,558,654	523,000.00	176,774,000	1.81
日本	投資証券	フロンティア不動産投資	318	481,048.15	152,973,313	543,000.00	172,674,000	1.77

日本	投資証券	インヴィンシブル投資法	3,775	38,789.40	146,429,968	41,850.00	157,983,750	1.62
日本	投資証券	森ヒルズリート	1,008	139,567.79	140,684,336	153,000.00	154,224,000	1.58
日本	投資証券	イオンリート投資	948	142,839.26	135,411,617	156,100.00	147,982,800	1.52
日本	投資証券	大和証券リビング投	1,156	106,926.45	123,606,980	125,800.00	145,424,800	1.49
日本	投資証券	ケネディクスレジデンシャル	616	193,850.56	119,411,947	223,700.00	137,799,200	1.41
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル	400	312,018.28	124,807,313	336,500.00	134,600,000	1.38
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法	803	156,298.45	125,507,652	166,700.00	133,860,100	1.37
日本	投資証券	三菱地所物流REIT	265	439,932.55	116,582,126	477,500.00	126,537,500	1.30
日本	投資証券	N T T都市開発リート投	826	148,562.74	122,712,827	152,500.00	125,965,000	1.29

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.83
合計	98.83

外国リート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年7月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	92,800	19,172.54	1,779,211,890	17,822.36	1,653,915,379	6.71
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	11,400	94,378.49	1,075,914,796	95,749.44	1,091,543,605	4.43
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	19,132	47,161.93	902,302,012	45,377.03	868,153,357	3.52
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	75,700	8,913.01	674,714,964	9,899.22	749,370,908	3.04
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	57,200	11,162.87	638,516,376	11,573.77	662,019,518	2.69
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	35,760	18,070.48	646,200,406	18,432.15	659,133,587	2.68
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	41,400	18,083.83	748,670,698	14,465.19	598,858,890	2.43
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	121,500	3,825.23	464,765,581	4,549.82	552,802,887	2.24
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	17,500	31,473.69	550,789,556	28,569.63	499,968,462	2.03
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	42,392	11,331.68	480,372,558	10,465.93	443,671,598	1.80

アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	17,000	25,368.36	431,262,105	25,325.53	430,533,931	1.75
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,731	25,002.47	468,321,305	21,968.35	411,489,201	1.67
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	47,700	7,118.10	339,533,444	8,406.39	400,985,017	1.63
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	215,000	2,021.19	434,556,193	1,864.22	400,806,870	1.63
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	76,600	5,010.92	383,836,605	5,198.64	398,215,686	1.62
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	14,648	27,096.81	396,914,137	24,766.89	362,785,461	1.47
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	49,400	7,074.32	349,471,166	7,177.41	354,563,816	1.44
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	15,344	23,831.64	365,672,643	21,992.58	337,454,175	1.37
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,305	42,190.26	350,390,109	38,336.93	318,388,187	1.29
香港	投資証券	LINK REIT	262,700	1,103.66	289,932,156	1,117.32	293,520,620	1.19
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	23,762	10,322.26	245,277,459	11,418.97	271,337,477	1.10
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	150,500	1,995.30	300,292,692	1,737.74	261,529,162	1.06
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	13,588	21,368.61	290,356,720	19,024.43	258,503,972	1.05
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	68,819	4,122.44	283,701,941	3,700.43	254,659,816	1.03
アメリカ	投資証券	UDR INC	37,411	7,249.00	271,192,523	6,496.28	243,032,278	0.99
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	35,623	6,254.69	222,810,823	6,461.28	230,170,177	0.93
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	75,768	3,184.57	241,288,140	2,942.57	222,952,992	0.91
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	17,847	15,967.26	284,967,626	12,125.67	216,406,811	0.88
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	88,442	2,500.77	221,173,059	2,410.87	213,221,731	0.87
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	21,675	10,037.83	217,569,916	9,823.84	212,931,684	0.86

□ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.60
合計	98.60

ゴールド・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

2022年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信 託受益 証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	340,510	4,837.5752	1,647,242,714	4,693.8507	1,598,303,101	71.72
アメリカ	投資信 託受益 証券	ISHARES GOLD TRUST	140,690	4,684.3465	659,040,706	4,489.2435	631,591,668	28.34

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	100.07
合計	100.07

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

ゴールド・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド(Ｂ号)

2022年7月29日現在

種類	国/地域	取引所等	名称	買建/売建	数量	通貨	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
株価指数 先物取引	日本	大阪取引所	TOPIX 先物 0409 月 2022年 9月	買建	136	日本・円	2,650,789,600	2,635,000,000	1.24

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

種類	国/地域	取引所等	名称	買建/売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価(円)	評価額	時価(円)	投資比率(%)
株価指数 先物取引	イギリス	ICE EU	FTSE 100 INDEX SEP 22 2022年9月	買建	46	イギリス・ポンド	3,311,402.00	542,606,331	3,356,160.00	549,940,377	0.13
	ドイツ	EU REX	EURO STOX 50 SEP 22 2022年9月	買建	340	ユーロ	11,997,300.00	1,646,629,425	12,399,800.00	1,701,872,550	0.42
	アメリカ	シカゴ商品取引所	S&P 500 EMIN INDEX SEP 22 2022年9月	買建	336	アメリカ・ドル	65,530,558.00	8,821,068,412	68,434,800.00	9,212,008,428	2.26
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES SEP 22 2022年9月	買建	26	オーストラリア・ドル	4,314,117.00	406,389,821	4,414,150.00	415,812,930	0.10

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2022年7月29日現在

種類	資産の名称	買建/売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	6,480,000.00	879,742,479	872,003,885	0.21
	カナダ・ドル	買建	2,640,000.00	280,659,435	277,327,589	0.07
	スイス・フラン	買建	1,710,000.00	243,191,800	241,229,700	0.06

ユーロ	買建	830,000.00	114,849,344	113,914,056	0.03
スウェーデン・クローナ	買建	5,910,000.00	78,597,389	78,005,676	0.02
香港・ドル	買建	4,250,000.00	73,977,273	72,878,493	0.02
イギリス・ポンド	買建	400,000.00	65,940,080	65,529,256	0.02
デンマーク・クローネ	買建	3,470,000.00	64,663,774	63,986,800	0.02
オーストラリア・ドル	買建	370,000.00	35,050,230	34,845,494	0.01
シンガポール・ドル	買建	340,000.00	33,482,563	33,162,519	0.01
ノルウェー・クローネ	買建	1,370,000.00	18,991,494	18,971,616	0.00
イスラエル・シケル	買建	430,000.00	17,091,315	16,955,387	0.00
ニュージーランド・ドル	買建	50,000.00	4,264,849	4,231,014	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

種類	国/ 地域	取引 所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価 指数 先物 取引	アメ リカ	I C E - U S	M S C I E M G M K T S E P 2 2 2022年9月	買建	703	アメ リカ・ド ル	35,105,703.00	4,725,578,680	35,262,480.00	4,746,682,432	20.58

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2022年7月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	1,236,588.55	168,000,000	166,408,965	0.72

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年7月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	86,650,000.00	11,732,864,031	11,655,568,780	48.66
	ユーロ	売建	57,320,000.00	8,142,481,709	7,866,613,996	32.84
	イギリス・ポンド	売建	7,120,000.00	1,171,537,148	1,166,085,832	4.87
	オフショア・人民元	売建	26,660,000.00	538,335,409	531,259,152	2.22
	カナダ・ドル	売建	4,510,000.00	473,962,345	473,561,726	1.98
	オーストラリア・ドル	売建	3,760,000.00	350,428,512	353,997,984	1.48
	シンガポール・ドル	売建	2,240,000.00	218,011,024	218,375,360	0.91
	メキシコ・ペソ	売建	26,820,000.00	179,356,873	177,508,170	0.74
	ポーランド・ズロチ	売建	3,280,000.00	98,512,143	94,310,496	0.39
	イスラエル・シケル	売建	2,340,000.00	90,894,565	92,255,670	0.39
デンマーク・クローネ	売建	4,610,000.00	88,043,620	85,008,400	0.35	

	スウェーデン・クローナ	売建	4,670,000.00	61,747,419	61,629,056	0.26
	ノルウェー・クローネ	売建	3,490,000.00	47,996,644	48,313,815	0.20

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	120,000.00	16,250,400	16,149,720	0.98

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
リート指 数先物取 引	日本	大阪取引 所	TREI T 先 物 0409 月 2022年 9月	買建	20	日本・円	39,772,400	40,200,000	0.41

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	267,291.11	36,200,000	35,968,457	0.15
	オーストラリア・ドル	買建	82,055.04	7,800,000	7,727,833	0.03
	イギリス・ポンド	買建	27,268.28	4,500,000	4,467,493	0.02
	シンガポール・ドル	買建	43,785.49	4,300,000	4,270,561	0.02
	ユーロ	買建	31,078.42	4,300,000	4,265,404	0.02
	香港・ドル	買建	108,879.40	1,900,000	1,867,074	0.01
	カナダ・ドル	買建	16,908.89	1,800,000	1,776,261	0.01
	アメリカ・ドル	売建	22,634.41	3,100,000	3,046,161	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

ゴールド・インデックス・マザーファンド

2022年7月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	277,000.00	37,278,576	37,278,937	1.67

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

参考情報

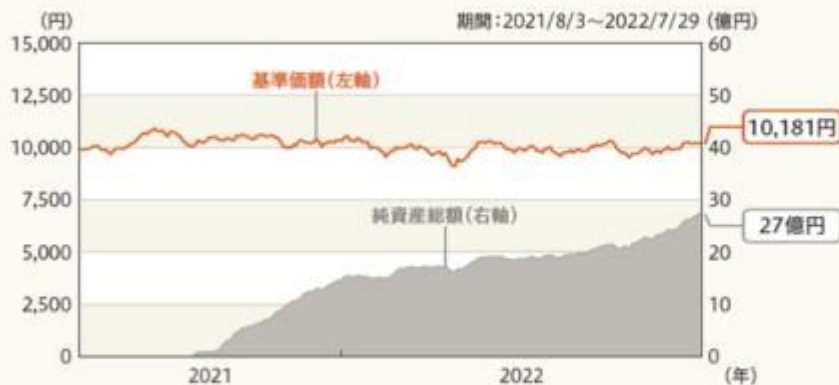
基準日: 2022年7月29日

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

基準価額・純資産の推移

分配の推移

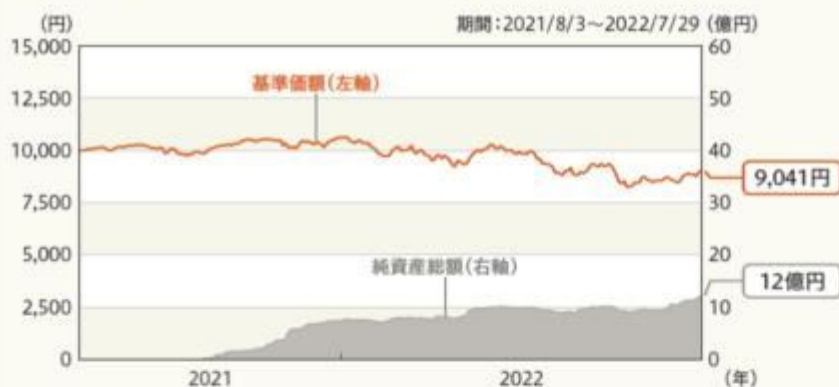
■日本株インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

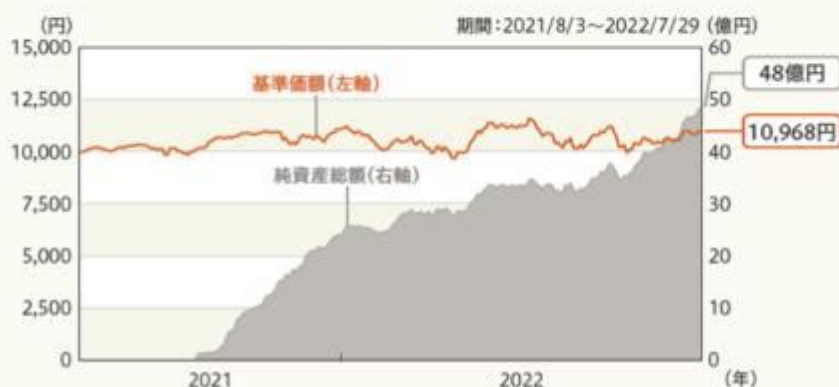
■先進国株インデックスヘッジ有



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

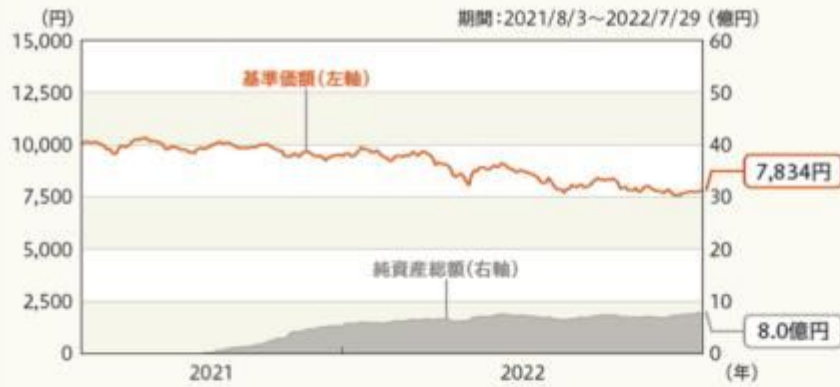
■先進国株インデックスヘッジ無



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

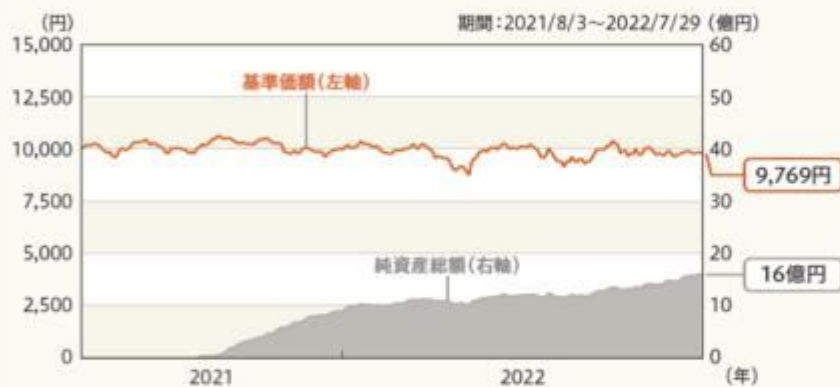
■新興国株インデックスヘッジ有



該当事項はありません。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

■新興国株インデックスヘッジ無



該当事項はありません。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

■日本債インデックス



該当事項はありません。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

■先進国債インデックスヘッジ有



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

■先進国債インデックスヘッジ無



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

■新興国債インデックスヘッジ有



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

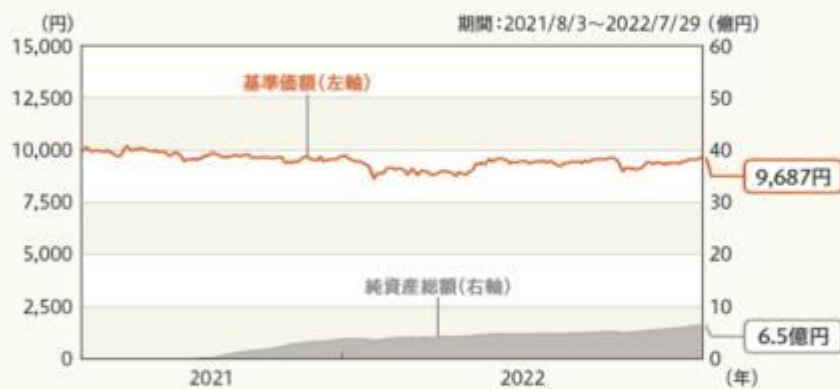
■新興国債インデックスヘッジ無



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

■Jリートインデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

■Gリートインデックスヘッジ有



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

■Gリートインデックスヘッジ無



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

■ゴールドヘッジ有



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

■ゴールドヘッジ無



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

該当事項はありません。

主要な資産の状況

■日本株インデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.04
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	100.04

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.27
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.24%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.87
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.91
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.89
日本	株式	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.71
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.67
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.35
日本	株式	任天堂	その他製品	1.34
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.31
日本	株式	日立	電気機器	1.28
日本	株式	武田薬品	医薬品	1.23

■先進国株インデックスヘッジ有

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	98.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.26
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	98.74

■先進国株インデックスヘッジ無

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.04
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	100.04

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	67.29
	イギリス	4.15
	カナダ	3.68
	スイス	3.23
	フランス	2.88
	ドイツ	2.08
	その他	11.28
投資証券	アメリカ・その他	2.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.84
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.91%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ソフトウェア・ハードウェア	5.08
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.90
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.22
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.47
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.36
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.29
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1.01
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・ヘルスケア	0.91
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	0.89
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	0.78

■新興国株インデックスヘッジ有

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	98.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.69
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	98.31

■新興国株インデックスヘッジ無

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.08
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	100.08

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	ケイマン諸島	14.93
	台湾	11.33
	インド	10.91
	韓国	9.50
	中国	5.63
	その他	16.35
投資証券	アメリカ・その他	6.67
投資信託受益証券	香港	4.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		20.32
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 20.58%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	5.05
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	4.36
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	3.56
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	3.13
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ソフトウェア・ハードウェア	2.80
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	2.35
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	1.20
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1.16
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	1.07
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	0.84

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有益証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■日本債インデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.04
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託 受益証券	国内債券(NOMURA-BPI) マザーファンド	100.04

■国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	77.33
地方債証券	日本	9.42
特殊債券	日本	7.62
社債券	日本	5.03
	フランス	0.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.52
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	435 2年国債	0.005	2024/04/01	4.74
日本	国債証券	149 5年国債	0.005	2026/09/20	1.20
日本	国債証券	360 10年国債	0.100	2030/09/20	1.17
日本	国債証券	146 5年国債	0.100	2025/12/20	1.03
日本	国債証券	150 5年国債	0.005	2026/12/20	1.01
日本	国債証券	144 5年国債	0.100	2025/06/20	0.98
日本	国債証券	357 10年国債	0.100	2029/12/20	0.97
日本	国債証券	361 10年国債	0.100	2030/12/20	0.96
日本	国債証券	358 10年国債	0.100	2030/03/20	0.94
日本	国債証券	344 10年国債	0.100	2026/09/20	0.92

■先進国債インデックスヘッジ有

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.05
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託 受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・ マザーファンド	100.05

■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	49.22
	フランス	8.58
	イタリア	7.56
	ドイツ	6.39
	スペイン	5.13
	イギリス	4.94
	中国	2.19
	その他	12.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.07
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/10/15	0.59
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.910	2028/10/14	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2030/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.750	2023/12/31	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2032/02/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2023/11/30	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2023/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2024/05/15	0.50

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■先進国債インデックスヘッジ無

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.05
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	100.05

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	50.26
	フランス	8.78
	イタリア	7.80
	ドイツ	6.55
	スペイン	5.19
	イギリス	5.03
	中国	2.24
	その他	13.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.02
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	1.21
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	1.10
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/05/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2026/02/28	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/08/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2026/08/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/12/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2030/05/15	0.54

■新興国債インデックスヘッジ有

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	97.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.80
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	97.20

■新興国債インデックスヘッジ無

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.97
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	99.03

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	サウジアラビア	10.04
	メキシコ	9.80
	カタール	9.16
	アラブ首長国連邦	7.83
	ブラジル	6.25
	コロンビア	6.12
	トルコ	6.08
	その他	40.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.91
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.250	2033/02/02	10.04
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	3.750	2030/04/16	9.16
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2.659	2031/05/24	6.95
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INTL	1.875	2031/09/15	5.80
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNL BOND	6.250	2031/01/25	4.81
パナマ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	2.252	2032/09/29	3.90
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	6.000	2033/02/22	3.64
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	3.875	2030/06/12	3.63
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	6.125	2028/10/24	3.19
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.875	2030/06/22	3.11

■Jリートインデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.05
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	100.05

■Jリート・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	日本	98.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.17
合計(純資産総額)		100.00

*リート指数先物取引の買建て 0.41%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド	7.25
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト	5.65
日本	投資証券	日本プロロジスリート	4.99
日本	投資証券	日本都市ファンド	4.82
日本	投資証券	GLP投資法人	4.75
日本	投資証券	野村不動産マスターF	4.75
日本	投資証券	大和ハウスリート	4.25
日本	投資証券	オリックス不動産投資	3.35
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス	3.23
日本	投資証券	ユナイテッドアーバン投資	2.87

■Gリートインデックスヘッジ有

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	98.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.21
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	98.79

*比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

*「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■Gリートインデックスヘッジ無

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.06
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	100.06

■外国リート・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	アメリカ	76.39
	オーストラリア	6.27
	イギリス	5.05
	シンガポール	3.52
	カナダ	1.79
	フランス	1.53
	香港	1.45
	その他	2.59
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	6.71
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	4.43
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.52
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3.04
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.69
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2.68
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	2.43
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	2.24
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.03
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	1.80

■ゴールドヘッジ有

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	97.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.38
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	97.62

■ゴールドヘッジ無

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.01
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	99.99

■ゴールド・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	100.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.07
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	71.72
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	28.34

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■日本株インデックス (ベンチマーク:TOPIX(東証株価指数、配当込み))



■先進国株インデックスヘッジ有 (ベンチマーク:MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ヘッジ換算ベース))



■先進国株インデックスヘッジ無 (ベンチマーク:MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース))

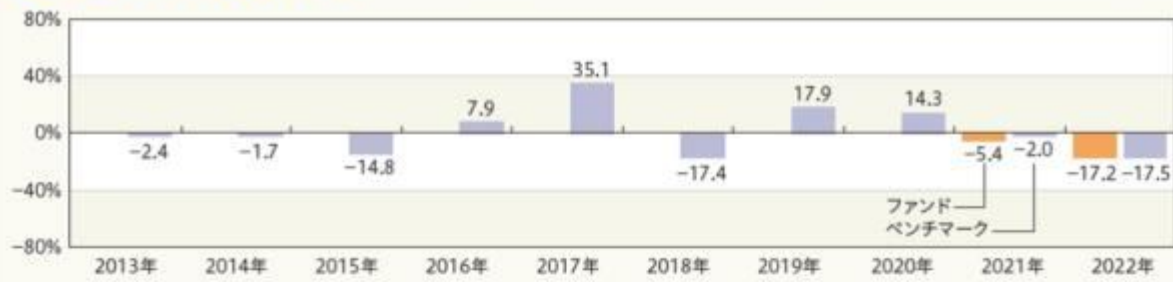


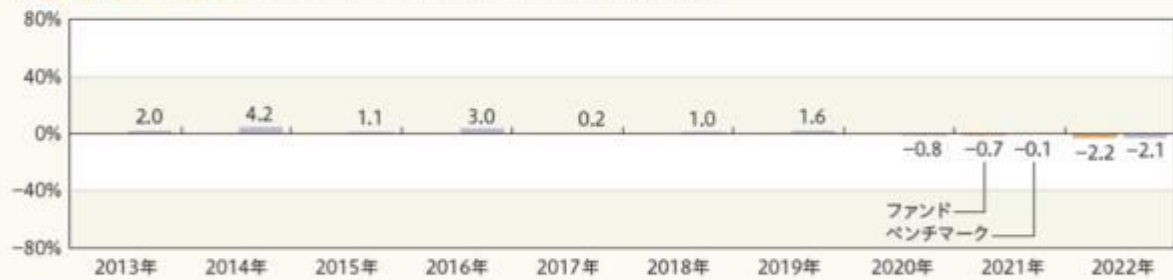
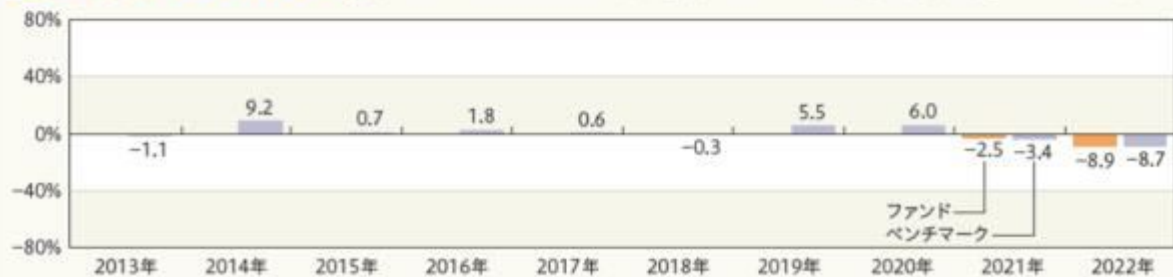
※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2022年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

■新興国株インデックスヘッジ有 (ベンチマーク:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み,米ドル円ヘッジ換算ベース))

■新興国株インデックスヘッジ無 (ベンチマーク: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))

■日本債インデックス (ベンチマーク:NOMURA-BPI(総合))

■先進国債インデックスヘッジ有 (ベンチマーク:FTSE世界国債インデックス(除く日本,円ヘッジベース))


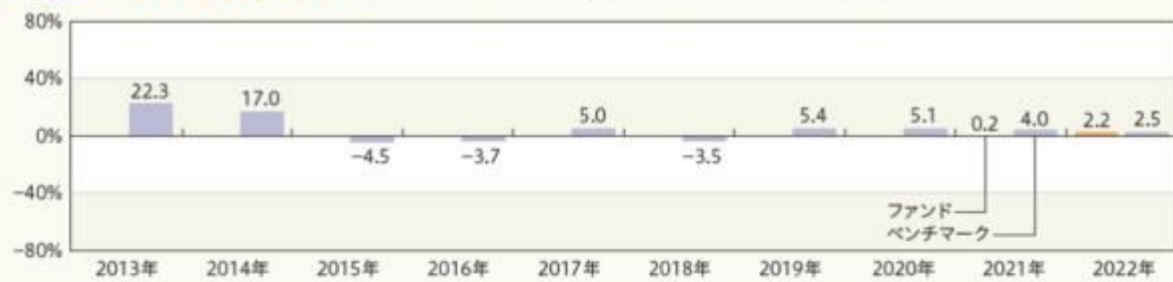
※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2022年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

■先進国債インデックスヘッジ無（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））



■新興国債インデックスヘッジ有（ベンチマーク：JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジ換算ベース））



■新興国債インデックスヘッジ無（ベンチマーク：JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース））



■Jリートインデックス（ベンチマーク：東証REIT指数（配当込み））



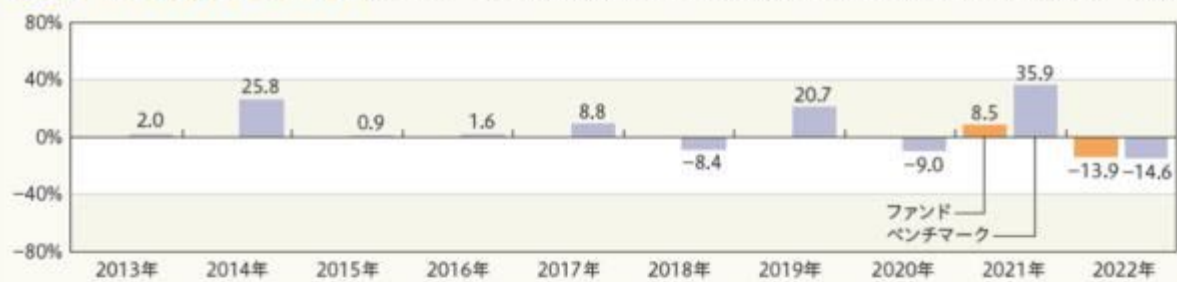
※ファンドの収益率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2022年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

■Gリートインデックスヘッジ有（ベンチマーク：S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース））



■Gリートインデックスヘッジ無（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））



■ゴールドヘッジ有（ベンチマーク：LBMA金価格（円ヘッジ換算ベース））



■ゴールドヘッジ無（ベンチマーク：LBMA金価格（円換算ベース））



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

※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2022年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

（イ）当ファンドは日興ファンドラップ専用ファンドです。取得申込みにあたっては、販売会社所定の手続きが必要となります。詳しくは販売会社までお問い合わせください。

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

お申込みの販売会社にお問い合わせください。

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

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

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

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(二) 申込不可日

上記にかかわらず、各ファンドにつき、取得申込日が以下の申込不可日に当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません(また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。)。

ファンド名	申込不可日
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ ロンドンの取引所の休業日
新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ ロンドンの取引所の休業日 ・ 香港の取引所の休業日
先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無	・ ニューヨークの銀行の休業日 ・ ロンドンの銀行の休業日
新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ ロンドンの取引所の休業日 ・ ニューヨークの銀行の休業日 ・ ロンドンの銀行の休業日
Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ オーストラリアの取引所の休業日 ・ ニューヨークの銀行の休業日
ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ ニューヨークの銀行の休業日

「日本株インデックス」、「日本債インデックス」、「Jリートインデックス」は、申込不可日はありません。

ロ 申込価額

各ファンドにつき、以下の通りとなります。

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

ファンド名	申込価額
日本株インデックス 日本債インデックス Jリートインデックス	取得申込受付日の基準価額となります。

先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無 新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無 先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無 新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無 Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無 ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。
--	-------------------------

八 申込手数料

ありません。

二 申込単位

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

へ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、各ファンドにつき、以下の申込金額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

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

ファンド名	申込金額
日本株インデックス 日本債インデックス Jリートインデックス	取得申込受付日の基準価額 × 申込口数
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無 新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無 先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無 新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無 Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無 ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	取得申込受付日の翌営業日の基準価額 × 申込口数

2 【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下の申込不可日に当たる場合には、解約請求の受付は行いません。

ファンド名	申込不可日
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日
新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・香港の取引所の休業日
先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無	・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・オーストラリアの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日
ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日

「日本株インデックス」、「日本債インデックス」、「Jリートインデックス」は、申込不可日はありません。

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

一部解約金は、各ファンドにつき、解約請求受付日から起算して以下の日からお支払いします。

ファンド名	一部解約金支払開始日
日本株インデックス 日本債インデックス	4営業日目
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無 先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無 Jリートインデックス Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無 ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	5営業日目
新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無 新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無	6営業日目

一部解約価額は、各ファンドにつき、以下の通りとなります。

ファンド名	一部解約価額
-------	--------

日本株インデックス 日本債インデックス Jリートインデックス	解約請求受付日の基準価額
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無 新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無 先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無 新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無 Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無 ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	解約請求受付日の翌営業日の基準価額

解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。投資対象とする親投資信託受益証券は、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価します。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< 主要投資対象の評価方法 >

「各マザーファンド（ゴールド・インデックス・マザーファンドを除く）」

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

国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産につ

いては原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

「ゴールド・インデックス・マザーファンド」

主要投資対象	有価証券等の評価方法
投資信託証券	原則として、基準価額計算日に知りうる直近の純資産価格(基準価額)で評価します。また、上場されている場合は、その主たる取引所における最終相場で評価します。

国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産につ

いては原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

□ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、以下の通り掲載されます。

ファンド名	掲載名
日本株インデックス	NS日株イ
先進国株インデックスヘッジ有	NS先株イ有
先進国株インデックスヘッジ無	NS先株イ無
新興国株インデックスヘッジ有	NS興株イ有
新興国株インデックスヘッジ無	NS興株イ無
日本債インデックス	NS日債イ
先進国債インデックスヘッジ有	NS先債イ有
先進国債インデックスヘッジ無	NS先債イ無
新興国債インデックスヘッジ有	NS興債イ有
新興国債インデックスヘッジ無	NS興債イ無
Jリートインデックス	NSJリイ
Gリートインデックスヘッジ有	NSGリイ有
Gリートインデックスヘッジ無	NSGリイ無
ゴールドヘッジ有	NS金イ有
ゴールドヘッジ無	NS金イ無

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

2021年8月3日から下記「(5)その他イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年8月1日から翌年7月31日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドの残存口数が30億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社

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

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

(ロ) 償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。

八 信託約款の変更等

(イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)

(ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

(ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および

償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページで閲覧できます。

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

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

ハ 一部解約実行請求権

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

二 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期(2021年8月3日から2022年8月1日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【日興FWS・日本株インデックス】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	40
コール・ローン	1,184
親投資信託受益証券	2,800,335,541
流動資産合計	2,800,336,765
資産合計	2,800,336,765
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	217,094
未払委託者報酬	977,091
その他未払費用	54,198
流動負債合計	1,248,383
負債合計	1,248,383
純資産の部	
元本等	
元本	2,721,511,626
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	77,576,756
(分配準備積立金)	40,740,981
元本等合計	2,799,088,382
純資産合計	2,799,088,382
負債純資産合計	2,800,336,765

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	2
有価証券売買等損益	36,694,322
営業収益合計	36,694,324
営業費用	
支払利息	381
受託者報酬	284,944
委託者報酬	1,282,484
その他費用	71,121
営業費用合計	1,638,930
営業利益又は営業損失()	35,055,394
経常利益又は経常損失()	35,055,394
当期純利益又は当期純損失()	35,055,394
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()	5,685,587
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	40,745,839
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	40,745,839
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,910,064
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,910,064
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	77,576,756

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	2,721,511,626口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0285円 (1万口当たりの純資産額10,285円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（28,080,217円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（12,660,764円）、収益調整金（36,835,775円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は77,576,756円（1万口当たり285.05円）ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日

1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 2021年8月3日 至 2022年8月1日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	38,586,581円
合計	38,586,581円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	2,889,422,774円
期中一部解約元本額	168,911,148円

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	841,851,714	2,800,335,541	
	親投資信託受益証券 小計		2,800,335,541	
合計			2,800,335,541	

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。

【日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	8,715
コール・ローン	258,450
親投資信託受益証券	1,218,728,947
派生商品評価勘定	31,061,900
流動資産合計	1,250,058,012
資産合計	1,250,058,012
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	286,684
未払解約金	265,975
未払受託者報酬	102,063
未払委託者報酬	459,419
その他未払費用	30,548
流動負債合計	1,144,689
負債合計	1,144,689
純資産の部	
元本等	
元本	1,363,843,700
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	114,930,377
(分配準備積立金)	10,680,473
元本等合計	1,248,913,323
純資産合計	1,248,913,323
負債純資産合計	1,250,058,012

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
有価証券売買等損益	46,010,536
為替差損益	130,876,780
営業収益合計	84,866,244
営業費用	
支払利息	723
受託者報酬	134,580
委託者報酬	605,874
その他費用	40,285
営業費用合計	781,462
営業利益又は営業損失（ ）	85,647,706
経常利益又は経常損失（ ）	85,647,706
当期純利益又は当期純損失（ ）	85,647,706
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（ ）	5,347,052
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,629,723
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	176,774
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,452,949
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	114,930,377

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期	
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	
	(2022年8月1日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,363,843,700口	
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	114,930,377円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9157円 (1万口当たりの純資産額9,157円)	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期	
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日	
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（10,680,473円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（964,825円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は11,645,298円（1万口当たり85.39円）であります。分配を行っておりません。</p>	

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月3日 至 2022年8月1日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	45,304,257円

合計	45,304,257円
----	-------------

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカ・ドル	941,671,545	-	913,638,454	28,033,091
	カナダ・ドル	45,022,332	-	44,315,082	707,250
	オーストラリア・ド ル	26,732,080	-	26,836,160	104,080
	イギリス・ボンド	54,618,060	-	54,144,224	473,836
	スイス・フラン	36,234,175	-	36,159,531	74,644
	スウェーデン・ク ローナ	11,776,073	-	11,883,986	107,913
	ユーロ	105,781,457	-	104,083,069	1,698,388
	小計	1,221,835,722	-	1,191,060,506	30,775,216
合 計	1,221,835,722	-	1,191,060,506	30,775,216	

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期	
	(2022年8月1日現在)	
期首元本額		1,000,000円
期中追加設定元本額		1,403,107,104円
期中一部解約元本額		40,263,404円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
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	202,446,669	1,218,728,947	
	親投資信託受益証券 小計		1,218,728,947	
合計			1,218,728,947	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	38
コール・ローン	1,121
親投資信託受益証券	4,922,876,015
流動資産合計	4,922,877,174
資産合計	4,922,877,174
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	373,405
未払委託者報酬	1,680,456
その他未払費用	111,940
流動負債合計	2,165,801
負債合計	2,165,801
純資産の部	
元本等	
元本	4,482,657,360
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	438,054,013
(分配準備積立金)	140,942,036
元本等合計	4,920,711,373
純資産合計	4,920,711,373
負債純資産合計	4,922,877,174

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	8
有価証券売買等損益	145,167,613
営業収益合計	145,167,621
営業費用	
支払利息	392
受託者報酬	485,447
委託者報酬	2,184,769
その他費用	145,517
営業費用合計	2,816,125
営業利益又は営業損失()	142,351,496
経常利益又は経常損失()	142,351,496
当期純利益又は当期純損失()	142,351,496
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()	1,409,460
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	311,613,406
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	311,613,406
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,501,429
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,501,429
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	438,054,013

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期
	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	4,482,657,360口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0977円 (1万口当たりの純資産額10,977円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（40,022,964円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（100,919,072円）、収益調整金（297,111,977円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は438,054,013円（1万口当たり977.22円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日

1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期（自 2021年8月3日 至 2022年8月1日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	145,395,974円
合計	145,395,974円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	4,694,605,698円
期中一部解約元本額	212,948,338円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
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	817,753,491	4,922,876,015	
	親投資信託受益証券 小計		4,922,876,015	
合計			4,922,876,015	

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。

【日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	4,127
コール・ローン	122,393
親投資信託受益証券	775,886,770
派生商品評価勘定	23,910,419
未収入金	23,986
流動資産合計	799,947,695
資産合計	799,947,695
負債の部	
流動負債	
未払解約金	124,800
未払受託者報酬	75,438
未払委託者報酬	603,814
その他未払費用	26,325
流動負債合計	830,377
負債合計	830,377
純資産の部	
元本等	
元本	1,025,486,262
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	226,368,944
(分配準備積立金)	11,335,895
元本等合計	799,117,318
純資産合計	799,117,318
負債純資産合計	799,947,695

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	8
有価証券売買等損益	32,374,873
為替差損益	113,001,247
営業収益合計	145,376,112
営業費用	
支払利息	309
受託者報酬	100,122
委託者報酬	801,475
その他費用	34,920
営業費用合計	936,826
営業利益又は営業損失（ ）	146,312,938
経常利益又は経常損失（ ）	146,312,938
当期純利益又は当期純損失（ ）	146,312,938
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（ ）	6,124,087
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,492,785
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,492,785
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	88,672,878
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	88,672,878
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	226,368,944

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,025,486,262口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 226,368,944円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.7793円 (1万口当たりの純資産額7,793円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（11,335,895円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（1,558,995円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は12,894,890円（1万口当たり125.74円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 2021年8月3日 至 2022年8月1日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	27,869,490円

合計	27,869,490円
----	-------------

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	803,020,845	-	779,110,426	23,910,419
	小計	803,020,845	-	779,110,426	23,910,419
合 計		803,020,845	-	779,110,426	23,910,419

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,068,832,666円
期中一部解約元本額	44,346,404円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	エマージング株式インデックス・マ ザーファンド	474,142,490	775,886,770	
	親投資信託受益証券 小計		775,886,770	
合 計			775,886,770	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	45
コール・ローン	1,343
親投資信託受益証券	1,594,235,992
流動資産合計	1,594,237,380
資産合計	1,594,237,380
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	134,365
未払委託者報酬	1,075,358
その他未払費用	46,959
流動負債合計	1,256,682
負債合計	1,256,682
純資産の部	
元本等	
元本	1,660,054,229
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	67,073,531
(分配準備積立金)	20,898,206
元本等合計	1,592,980,698
純資産合計	1,592,980,698
負債純資産合計	1,594,237,380

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	3
有価証券売買等損益	73,485,584
営業収益合計	73,485,581
営業費用	
支払利息	201
受託者報酬	177,188
委託者報酬	1,418,185
その他費用	61,885
営業費用合計	1,657,459
営業利益又は営業損失()	75,143,040
経常利益又は経常損失()	75,143,040
当期純利益又は当期純損失()	75,143,040
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	3,730,819
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,759,644
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,759,644
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,420,954
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,420,954
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	67,073,531

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期
	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,660,054,229口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 67,073,531円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9596円 (1万口当たりの純資産額9,596円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(20,898,206円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(3,044,583円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は23,942,789円(1万口当たり144.23円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月3日 至 2022年8月1日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	71,790,746円
合計	71,790,746円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,779,724,937円
期中一部解約元本額	120,670,708円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マ ザーファンド	974,233,679	1,594,235,992	
	親投資信託受益証券 小計		1,594,235,992	
合計			1,594,235,992	

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。

【日興FWS・日本債インデックス】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	7,225
コール・ローン	214,284
親投資信託受益証券	4,104,484,560
流動資産合計	4,104,706,069
資産合計	4,104,706,069
負債の部	
流動負債	
未払解約金	219,766
未払受託者報酬	348,339
未払委託者報酬	1,393,490
その他未払費用	69,601
流動負債合計	2,031,196
負債合計	2,031,196
純資産の部	
元本等	
元本	4,232,452,962
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	129,778,089
(分配準備積立金)	15,145,737
元本等合計	4,102,674,873
純資産合計	4,102,674,873
負債純資産合計	4,104,706,069

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	5
有価証券売買等損益	65,411,037
営業収益合計	65,411,032
営業費用	
支払利息	401
受託者報酬	471,148
委託者報酬	1,884,727
その他費用	94,117
営業費用合計	2,450,393
営業利益又は営業損失()	67,861,425
経常利益又は経常損失()	67,861,425
当期純利益又は当期純損失()	67,861,425
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()	4,133,294
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,551,329
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,551,329
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	68,601,287
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	68,601,287
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	129,778,089

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,232,452,962口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 129,778,089円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9693円 (1万口当たりの純資産額9,693円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(15,145,737円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(2,556,430円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は17,702,167円(1万口当たり41.82円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月3日 至 2022年8月1日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	63,280,350円
合計	63,280,350円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	4,506,092,311円
期中一部解約元本額	274,639,349円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内債券(NOMURA-BPI)マ ザーファンド	2,975,773,625	4,104,484,560	
	親投資信託受益証券 小計		4,104,484,560	
合計			4,104,484,560	

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。

【日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		1,929
コール・ローン		57,214
親投資信託受益証券		697,776,324
流動資産合計		697,835,467
資産合計		
697,835,467		
負債の部		
流動負債		
未払解約金		57,948
未払受託者報酬		63,432
未払委託者報酬		285,534
その他未払費用		15,775
流動負債合計		422,689
負債合計		
422,689		
純資産の部		
元本等		
元本		783,437,940
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		86,025,162
(分配準備積立金)		6,743,390
元本等合計		697,412,778
純資産合計		
697,412,778		
負債純資産合計		
697,835,467		

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	4
有価証券売買等損益	51,264,801
営業収益合計	51,264,797
営業費用	
支払利息	55
受託者報酬	83,879
委託者報酬	377,635
その他費用	20,821
営業費用合計	482,390
営業利益又は営業損失()	51,747,187
経常利益又は経常損失()	51,747,187
当期純利益又は当期純損失()	51,747,187
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	3,145,903
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,206,385
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,206,385
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	38,630,263
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	38,630,263
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	86,025,162

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期
	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	783,437,940口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 86,025,162円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.8902円 (1万口当たりの純資産額8,902円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,743,390円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,038,767円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は7,782,157円(1万口当たり99.33円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月3日 至 2022年8月1日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	49,265,806円
合計	49,265,806円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	818,677,926円
期中一部解約元本額	36,239,986円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	510,667,685	697,776,324	
	親投資信託受益証券 小計		697,776,324	
合計			697,776,324	

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。

【日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	49
コール・ローン	1,440
親投資信託受益証券	600,261,243
流動資産合計	600,262,732
資産合計	600,262,732
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	50,379
未払委託者報酬	226,851
その他未払費用	12,520
流動負債合計	289,750
負債合計	289,750
純資産の部	
元本等	
元本	590,998,190
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	8,974,792
(分配準備積立金)	8,228,982
元本等合計	599,972,982
純資産合計	599,972,982
負債純資産合計	600,262,732

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
有価証券売買等損益	8,461,556
営業収益合計	8,461,556
営業費用	
支払利息	34
受託者報酬	67,569
委託者報酬	304,333
その他費用	16,757
営業費用合計	388,693
営業利益又は営業損失（ ）	8,072,863
経常利益又は経常損失（ ）	8,072,863
当期純利益又は当期純損失（ ）	8,072,863
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（ ）	156,119
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	745,810
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	62,716
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	683,094
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,974,792

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	590,998,190口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0152円 (1万口当たりの純資産額10,152円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（6,117,979円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（2,111,003円）、収益調整金（745,810円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は8,974,792円（1万口当たり151.86円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日

1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 2021年8月3日 至 2022年8月1日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	8,664,947円
合計	8,664,947円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	627,252,986円
期中一部解約元本額	37,254,796円

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	296,483,870	600,261,243	
	親投資信託受益証券 小計		600,261,243	
合 計			600,261,243	

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。

【日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	79,815
コール・ローン	2,367,117
親投資信託受益証券	479,327,529
派生商品評価勘定	17,271,026
未収入金	492,022
流動資産合計	499,537,509
資産合計	499,537,509
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	51,318
未払委託者報酬	410,810
その他未払費用	34,633
流動負債合計	496,761
負債合計	496,761
純資産の部	
元本等	
元本	675,330,314
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	176,289,566
（分配準備積立金）	20,650,122
元本等合計	499,040,748
純資産合計	499,040,748
負債純資産合計	499,537,509

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	152
有価証券売買等損益	57,809,032
為替差損益	101,199,947
営業収益合計	159,008,827
営業費用	
支払利息	1,406
受託者報酬	116,012
委託者報酬	928,613
その他費用	48,325
営業費用合計	1,094,356
営業利益又は営業損失()	160,103,183
経常利益又は経常損失()	160,103,183
当期純利益又は当期純損失()	160,103,183
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()	35,417,397
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,005,778
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,005,778
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	58,609,558
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	58,609,558
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	176,289,566

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期	
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	
	(2022年8月1日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	675,330,314口	
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	176,289,566円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.7390円 (1万口当たりの純資産額7,390円)	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期	
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日	
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(20,650,122円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,541,356円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は22,191,478円(1万口当たり328.60円)ですが、分配を行っておりません。</p>	

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月3日 至 2022年8月1日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	32,410,540円

合計	32,410,540円
----	-------------

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	483,071,894	-	465,800,868	17,271,026
	小計	483,071,894	-	465,800,868	17,271,026
合 計		483,071,894	-	465,800,868	17,271,026

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	500,000,000円
期中追加設定元本額	533,256,409円
期中一部解約元本額	357,926,095円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マ ザーファンド	522,029,546	479,327,529	
	親投資信託受益証券 小計		479,327,529	
合 計			479,327,529	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	171,464
コール・ローン	5,085,197
親投資信託受益証券	904,720,480
流動資産合計	909,977,141
資産合計	909,977,141
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	74,525
未払委託者報酬	596,556
その他未払費用	30,606
流動負債合計	701,687
負債合計	701,687
純資産の部	
元本等	
元本	1,002,416,303
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	93,140,849
(分配準備積立金)	20,237,092
元本等合計	909,275,454
純資産合計	909,275,454
負債純資産合計	909,977,141

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	44
有価証券売買等損益	58,391,120
営業収益合計	58,391,076
営業費用	
支払利息	1,118
受託者報酬	102,422
委託者報酬	820,215
その他費用	30,613
営業費用合計	954,368
営業利益又は営業損失()	59,345,444
経常利益又は経常損失()	59,345,444
当期純利益又は当期純損失()	59,345,444
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()	6,300,478
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	718,040
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	718,040
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	40,813,923
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	40,813,923
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	93,140,849

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期
	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,002,416,303口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 93,140,849円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9071円 (1万口当たりの純資産額9,071円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(20,237,092円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(3,172,940円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は23,410,032円(1万口当たり233.54円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月3日 至 2022年8月1日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	56,248,529円
合計	56,248,529円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,072,795,109円
期中一部解約元本額	71,378,806円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マ ザーファンド	985,319,626	904,720,480	
	親投資信託受益証券 小計		904,720,480	
合計			904,720,480	

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。

【日興FWS・Jリートインデックス】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	7,586
コール・ローン	224,980
親投資信託受益証券	661,067,227
流動資産合計	661,299,793
資産合計	661,299,793
負債の部	
流動負債	
未払解約金	230,960
未払受託者報酬	53,287
未払委託者報酬	279,932
その他未払費用	13,245
流動負債合計	577,424
負債合計	577,424
純資産の部	
元本等	
元本	677,494,848
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	16,772,479
(分配準備積立金)	18,796,851
元本等合計	660,722,369
純資産合計	660,722,369
負債純資産合計	661,299,793

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	1
有価証券売買等損益	18,677,808
営業収益合計	18,677,809
営業費用	
支払利息	55
受託者報酬	70,701
委託者報酬	371,505
その他費用	17,540
営業費用合計	459,801
営業利益又は営業損失()	18,218,008
経常利益又は経常損失()	18,218,008
当期純利益又は当期純損失()	18,218,008
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()	578,843
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,446,511
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,446,511
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	37,015,841
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	37,015,841
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	16,772,479

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期
	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	677,494,848口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 16,772,479円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9752円 (1万口当たりの純資産額9,752円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(12,292,024円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(6,504,827円)、収益調整金(1,527,709円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は20,324,560円(1万口当たり300.00円)であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月3日 至 2022年8月1日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	19,008,202円
合計	19,008,202円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	706,908,297円
期中一部解約元本額	30,413,449円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	240,117,405	661,067,227	
	親投資信託受益証券 小計		661,067,227	
合計			661,067,227	

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。

【日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		1,199
コール・ローン		35,562
親投資信託受益証券		218,207,385
派生商品評価勘定		5,571,888
流動資産合計		223,816,034
資産合計		223,816,034
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		76,993
未払解約金		35,010
未払受託者報酬		20,048
未払委託者報酬		120,507
その他未払費用		5,941
流動負債合計		258,499
負債合計		258,499
純資産の部		
元本等		
元本		237,495,753
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		13,938,218
（分配準備積立金）		4,125,090
元本等合計		223,557,535
純資産合計		223,557,535
負債純資産合計		223,816,034

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	2
有価証券売買等損益	13,638,972
為替差損益	27,983,572
営業収益合計	14,344,598
営業費用	
支払利息	133
受託者報酬	26,372
委託者報酬	158,536
その他費用	7,772
営業費用合計	192,813
営業利益又は営業損失（ ）	14,537,411
経常利益又は経常損失（ ）	14,537,411
当期純利益又は当期純損失（ ）	14,537,411
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（ ）	1,342,069
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	742,876
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	276,658
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	466,218
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,938,218

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	237,495,753口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 13,938,218円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9413円 (1万口当たりの純資産額9,413円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,125,090円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（520,342円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は4,645,432円（1万口当たり195.60円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 2021年8月3日 至 2022年8月1日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	12,419,075円

合計	12,419,075円
----	-------------

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	176,612,790	-	171,534,756	5,078,034
	カナダ・ドル	3,896,278	-	3,834,466	61,812
	オーストラリア・ド ル	13,387,888	-	13,445,161	57,273
	香港・ドル	3,179,400	-	3,081,429	97,971
	シンガポール・ドル	7,052,495	-	6,956,007	96,488
	イギリス・ポンド	11,601,383	-	11,499,867	101,516
	ユーロ	7,301,538	-	7,185,191	116,347
	小計	223,031,772	-	217,536,877	5,494,895
合計	223,031,772	-	217,536,877	5,494,895	

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期	
	(2022年8月1日現在)	
期首元本額		1,000,000円
期中追加設定元本額		251,217,041円
期中一部解約元本額		14,721,288円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	外国リート・インデックス・マザー ファンド	72,268,459	218,207,385	
	親投資信託受益証券 小計		218,207,385	
合 計			218,207,385	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	49
コール・ローン	1,468
親投資信託受益証券	705,500,328
流動資産合計	705,501,845
資産合計	705,501,845
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	56,178
未払委託者報酬	337,304
その他未払費用	16,779
流動負債合計	410,261
負債合計	410,261
純資産の部	
元本等	
元本	617,730,700
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	87,360,884
(分配準備積立金)	36,420,706
元本等合計	705,091,584
純資産合計	705,091,584
負債純資産合計	705,501,845

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	1
有価証券売買等損益	38,572,392
営業収益合計	38,572,393
営業費用	
支払利息	47
受託者報酬	73,966
委託者報酬	444,050
その他費用	22,045
営業費用合計	540,108
営業利益又は営業損失()	38,032,285
経常利益又は経常損失()	38,032,285
当期純利益又は当期純損失()	38,032,285
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()	1,611,579
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	53,447,598
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	53,447,598
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,507,420
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,507,420
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	87,360,884

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	617,730,700口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1414円 (1万口当たりの純資産額11,414円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（12,091,263円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（24,329,443円）、収益調整金（50,940,178円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は87,360,884円（1万口当たり1,414.22円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日

1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 2021年8月3日 至 2022年8月1日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	38,283,380円
合計	38,283,380円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	650,494,466円
期中一部解約元本額	33,763,766円

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザー ファンド	233,655,802	705,500,328	
	親投資信託受益証券 小計		705,500,328	
合計			705,500,328	

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。

【日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	7,843
コール・ローン	232,589
親投資信託受益証券	366,151,173
派生商品評価勘定	14,003,619
未収入金	353,880
流動資産合計	380,749,104
資産合計	380,749,104
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	769,818
未払解約金	34,255
未払受託者報酬	37,634
未払委託者報酬	301,448
その他未払費用	14,602
流動負債合計	1,157,757
負債合計	1,157,757
純資産の部	
元本等	
元本	409,945,460
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	30,354,113
(分配準備積立金)	-
元本等合計	379,591,347
純資産合計	379,591,347
負債純資産合計	380,749,104

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	4
有価証券売買等損益	42,819,222
為替差損益	58,529,861
営業収益合計	15,710,635
営業費用	
支払利息	31
受託者報酬	49,102
委託者報酬	393,680
その他費用	28,242
営業費用合計	471,055
営業利益又は営業損失（ ）	16,181,690
経常利益又は経常損失（ ）	16,181,690
当期純利益又は当期純損失（ ）	16,181,690
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（ ）	118,465
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	625,586
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	625,586
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,916,474
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,916,474
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,354,113

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期	
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	
	(2022年8月1日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	409,945,460口	
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	30,354,113円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9260円 (1万口当たりの純資産額9,260円)	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期	
	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日	
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（0円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は0円（1万口当たり0.00円）ではありますが、分配を行っておりません。</p>	

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月3日 至 2022年8月1日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	31,599,645円
合計	31,599,645円

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	19,337,934	-	18,568,116	769,818
	小計	19,337,934	-	18,568,116	769,818
	売建				
	アメリカ・ドル	387,275,801	-	373,272,182	14,003,619
小計	387,275,801	-	373,272,182	14,003,619	
合計		406,613,735	-	391,840,298	13,233,801

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	430,017,114円
期中一部解約元本額	21,071,654円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	ゴールド・インデックス・マザーファ ンド	319,364,303	366,151,173	
	親投資信託受益証券 小計		366,151,173	
合 計			366,151,173	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期 (2022年 8月 1日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		16,038
コール・ローン		475,640
親投資信託受益証券		1,658,999,025
未収入金		1,400,200
流動資産合計		1,660,890,903
資産合計		1,660,890,903
負債の部		
流動負債		
未払解約金		427,458
未払受託者報酬		148,922
未払委託者報酬		1,191,612
その他未払費用		58,457
流動負債合計		1,826,449
負債合計		1,826,449
純資産の部		
元本等		
元本		1,448,204,617
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		210,859,837
(分配準備積立金)		128,553,284
元本等合計		1,659,064,454
純資産合計		1,659,064,454
負債純資産合計		1,660,890,903

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 2021年 8月 3日 至 2022年 8月 1日
営業収益	
受取利息	2
有価証券売買等損益	141,139,473
営業収益合計	141,139,475
営業費用	
支払利息	128
受託者報酬	195,303
委託者報酬	1,563,164
その他費用	58,457
営業費用合計	1,817,052
営業利益又は営業損失()	139,322,423
経常利益又は経常損失()	139,322,423
当期純利益又は当期純損失()	139,322,423
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()	10,772,754
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	84,079,652
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	84,079,652
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,769,484
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,769,484
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	210,859,837

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	1,448,204,617口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1456円 (1万口当たりの純資産額11,456円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（128,553,284円）、収益調整金（82,311,041円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は210,864,325円（1万口当たり1,456.04円）ではありますが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日

1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期（自 2021年8月3日 至 2022年8月1日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	136,506,125円
合計	136,506,125円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2022年8月1日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,530,395,090円
期中一部解約元本額	83,190,473円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	1,447,011,797	1,658,999,025	
	親投資信託受益証券 小計		1,658,999,025	
合計			1,658,999,025	

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)

「日興FWS・日本株インデックス」、「日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)」、「日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)」、「日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)」、「日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)」、「日興FWS・日本債インデックス」、「日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)」、「日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)」、「日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)」、「日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)」、「日興FWS・Jリートインデックス」、「日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)」、「日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)」、「日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)」および「日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」および「ゴールド・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1)貸借対照表

(単位:円)

		(2022年8月1日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		79,536,074
コール・ローン		2,358,837,044
株式		212,510,660,160
派生商品評価勘定		15,848,200
未収配当金		312,581,957
前払金		15,640,000
差入委託証拠金		112,200,000
流動資産合計		215,405,303,435
資産合計		215,405,303,435
負債の部		

流動負債		
未払解約金		182,960,917
その他未払費用		10,071
流動負債合計		182,970,988
負債合計		182,970,988
純資産の部		
元本等		
元本		64,701,881,641
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		150,520,450,806
元本等合計		215,222,332,447
純資産合計		215,222,332,447
負債純資産合計		215,405,303,435

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	64,701,881,641口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3264円 (1万口当たりの純資産額33,264円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式)</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0409月	2,689,641,800	-	2,705,490,000	15,848,200
	小計	2,689,641,800	-	2,705,490,000	15,848,200
合 計		2,689,641,800	-	2,705,490,000	15,848,200

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年8月1日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	61,200,724,965円
同期中における追加設定元本額	11,767,031,486円
同期中における一部解約元本額	8,265,874,810円
2022年8月1日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,573,090,801円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,004,663,066円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,610,963,182円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,537,445,009円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	123,076,527円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,516,917円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	19,787,928円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	62,765,654円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	164,455,970円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	144,990,932円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	258,828,264円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,450,073,440円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	20,759,518,567円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	248,448,491円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	303,821,509円

アセットアロケーション・ファンド(成長型)	196,873,415円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	35,615,877円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	188,415,610円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	173,706,323円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	621,999,724円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	343,048,809円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	391,665,566円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	44,825,074円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	734,157,443円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	38,614,587円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	184,340,098円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	174,426,464円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,502,614円
日興FWS・日本株インデックス	841,851,714円
三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド	13,445,845円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,663,979,908円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	13,143,735円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	87,961,192円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,655,765,464円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,580,942,741円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,930,118,160円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	38,205,939円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	155,884,619円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	714,123,301円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	46,213,392円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	254,234,553円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	800,284,752円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	584,992,310円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,804,290,327円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	372,784円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	40,445,248円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	45,792,382円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	34,436,924円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,874,370円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	108,886,518円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	241,137,387円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	57,601,073円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,288,518円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,593,251円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	43,263,100円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	582,844,403円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	176,594,530円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	211,396,741円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	98,339,458円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	134,762,191円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	51,649,054円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	41,352,519円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	28,748,353円

S M A M ・ マルチアセットストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 >	36,764,193円
S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	101,723,766円
S M D A M ・ 日米3資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	16,939,065円
合 計	64,701,881,641円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,500	3,650.000	12,775,000	
日本水産	106,900	597.000	63,819,300	
マルハニチロ	14,800	2,491.000	36,866,800	
雪国まいたけ	10,000	974.000	9,740,000	
カネコ種苗	5,900	1,647.000	9,717,300	
サカタのタネ	12,500	4,920.000	61,500,000	
ホクト	8,500	1,953.000	16,600,500	
日鉄鉱業	2,400	5,400.000	12,960,000	
三井松島ホールディングス	5,200	3,210.000	16,692,000	
I N P E X	365,300	1,506.000	550,141,800	
石油資源開発	13,700	3,485.000	47,744,500	
K & O エナジーグループ	5,200	1,566.000	8,143,200	
ショーボンドホールディングス	13,400	5,920.000	79,328,000	
ミライト・ワン	36,900	1,669.000	61,586,100	
タマホーム	7,100	2,476.000	17,579,600	
Robot Home	19,800	198.000	3,920,400	
安藤・間	52,300	887.000	46,390,100	
東急建設	33,500	636.000	21,306,000	
コムシスホールディングス	36,900	2,669.000	98,486,100	
ビーアールホールディングス	20,400	356.000	7,262,400	
高松コンストラクショングループ	7,400	2,119.000	15,680,600	
東建コーポレーション	3,100	8,920.000	27,652,000	
ヤマウラ	7,600	965.000	7,334,000	
オリエンタル白石	42,200	255.000	10,761,000	
大成建設	73,900	4,270.000	315,553,000	
大林組	245,800	986.000	242,358,800	
清水建設	227,500	753.000	171,307,500	
飛鳥建設	9,700	1,066.000	10,340,200	
長谷工コーポレーション	70,800	1,622.000	114,837,600	
松井建設	9,700	640.000	6,208,000	
銭高組	2,500	3,290.000	8,225,000	
鹿島建設	180,200	1,516.000	273,183,200	
不動テトラ	6,400	1,649.000	10,553,600	
大末建設	3,900	1,566.000	6,107,400	

鉄建建設	7,100	1,828.000	12,978,800
西松建設	16,500	3,990.000	65,835,000
三井住友建設	63,500	453.000	28,765,500
大豊建設	4,100	4,250.000	17,425,000
奥村組	13,200	2,962.000	39,098,400
東鉄工業	10,400	2,394.000	24,897,600
浅沼組	6,400	2,678.000	17,139,200
戸田建設	101,400	712.000	72,196,800
熊谷組	13,100	2,841.000	37,217,100
北野建設	5,000	2,217.000	11,085,000
矢作建設工業	10,900	810.000	8,829,000
ピーエス三菱	10,100	630.000	6,363,000
日本ハウスホールディングス	17,000	409.000	6,953,000
大東建託	27,200	12,490.000	339,728,000
新日本建設	10,700	752.000	8,046,400
東亜道路工業	1,600	5,930.000	9,488,000
日本道路	2,400	6,570.000	15,768,000
東亜建設工業	6,300	2,612.000	16,455,600
日本国土開発	21,500	607.000	13,050,500
若築建設	4,700	2,417.000	11,359,900
東洋建設	30,600	869.000	26,591,400
五洋建設	99,200	729.000	72,316,800
世紀東急工業	13,200	831.000	10,969,200
福田組	2,600	4,990.000	12,974,000
住友林業	52,800	2,076.000	109,612,800
日本基礎技術	13,100	599.000	7,846,900
巴コーポレーション	19,300	457.000	8,820,100
大和ハウス工業	210,100	3,319.000	697,321,900
ライト工業	13,800	1,949.000	26,896,200
積水ハウス	252,000	2,374.500	598,374,000
日特建設	6,800	863.000	5,868,400
北陸電気工事	1,100	776.000	853,600
ユアテック	14,700	737.000	10,833,900
日本リーテック	5,800	962.000	5,579,600
中電工	8,500	2,149.000	18,266,500
関電工	39,600	843.000	33,382,800
きんでん	52,000	1,561.000	81,172,000
東京エネシス	8,500	1,041.000	8,848,500
トーエネック	2,800	3,810.000	10,668,000
住友電設	6,200	2,563.000	15,890,600
日本電設工業	10,400	1,778.000	18,491,200
エクシオグループ	36,500	2,224.000	81,176,000
新日本空調	5,900	1,908.000	11,257,200
九電工	17,000	2,844.000	48,348,000
三機工業	16,900	1,661.000	28,070,900
日揮ホールディングス	75,400	1,677.000	126,445,800
中外炉工業	3,600	1,748.000	6,292,800
ヤマト	11,900	797.000	9,484,300

太平電業	4,900	3,080.000	15,092,000
高砂熱学工業	19,800	1,687.000	33,402,600
朝日工業社	3,600	1,916.000	6,897,600
明星工業	14,400	708.000	10,195,200
大気社	10,900	3,300.000	35,970,000
ダイダン	5,100	2,224.000	11,342,400
日比谷総合設備	7,200	1,947.000	14,018,400
テスホールディングス	8,200	1,231.000	10,094,200
インフロニア・ホールディングス	92,500	973.000	90,002,500
東洋エンジニアリング	12,500	669.000	8,362,500
レイズネクスト	10,800	1,228.000	13,262,400
ニッポン	19,900	1,621.000	32,257,900
日清製粉グループ本社	79,700	1,660.000	132,302,000
日東富士製粉	600	4,665.000	2,799,000
昭和産業	6,400	2,575.000	16,480,000
中部飼料	8,800	1,107.000	9,741,600
フィード・ワン	10,300	714.000	7,354,200
日本甜菜製糖	5,200	1,693.000	8,803,600
D M三井製糖ホールディングス	6,500	1,903.000	12,369,500
日新製糖	4,000	1,780.000	7,120,000
森永製菓	17,300	4,265.000	73,784,500
中村屋	2,800	3,175.000	8,890,000
江崎グリコ	19,900	3,855.000	76,714,500
名糖産業	3,600	1,688.000	6,076,800
井村屋グループ	4,400	2,300.000	10,120,000
不二家	4,600	2,405.000	11,063,000
山崎製パン	46,900	1,603.000	75,180,700
モロゾフ	2,900	3,650.000	10,585,000
亀田製菓	4,400	4,810.000	21,164,000
寿スピリッツ	7,400	7,670.000	56,758,000
カルビー	39,100	2,874.000	112,373,400
森永乳業	14,600	4,945.000	72,197,000
六甲バター	5,300	1,446.000	7,663,800
ヤクルト本社	54,000	8,540.000	461,160,000
明治ホールディングス	46,800	6,990.000	327,132,000
雪印メグミルク	18,800	1,873.000	35,212,400
プリマハム	10,400	2,297.000	23,888,800
日本ハム	29,900	3,955.000	118,254,500
丸大食品	8,500	1,597.000	13,574,500
S Foods	7,600	3,105.000	23,598,000
柿安本店	3,100	2,395.000	7,424,500
伊藤ハム米久ホールディングス	48,700	672.000	32,726,400
サッポロホールディングス	23,000	2,998.000	68,954,000
アサヒグループホールディングス	160,100	4,652.000	744,785,200
キリンホールディングス	312,900	2,211.000	691,821,900
宝ホールディングス	47,000	1,058.000	49,726,000
オエノンホールディングス	23,700	310.000	7,347,000
養命酒製造	1,400	1,820.000	2,548,000

コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	54,400	1,515.000	82,416,000
サントリー食品インターナショナル	48,600	5,270.000	256,122,000
ダイドーグループホールディングス	4,300	5,210.000	22,403,000
伊藤園	25,800	6,540.000	168,732,000
キーコーヒー	7,900	2,162.000	17,079,800
日清オイリオグループ	9,500	3,280.000	31,160,000
不二製油グループ本社	18,800	2,296.000	43,164,800
かどや製油	3,100	3,565.000	11,051,500
J - オイルミルズ	8,000	1,630.000	13,040,000
キッコーマン	50,800	8,110.000	411,988,000
味の素	169,800	3,723.000	632,165,400
ブルドックソース	3,500	1,859.000	6,506,500
キュービー	37,200	2,343.000	87,159,600
ハウス食品グループ本社	26,300	2,911.000	76,559,300
カゴメ	32,300	3,180.000	102,714,000
焼津水産化学工業	13,700	920.000	12,604,000
アリアケジャパン	7,700	5,410.000	41,657,000
ニチレイ	32,200	2,395.000	77,119,000
東洋水産	38,000	5,760.000	218,880,000
イトアンドホールディングス	4,000	2,463.000	9,852,000
日清食品ホールディングス	27,400	9,790.000	268,246,000
永谷園ホールディングス	4,300	2,038.000	8,763,400
フジッコ	7,900	1,960.000	15,484,000
ロック・フィールド	8,700	1,528.000	13,293,600
日本たばこ産業	456,100	2,331.000	1,063,169,100
ケンコーマヨネーズ	4,900	1,511.000	7,403,900
わらべや日洋ホールディングス	5,500	2,232.000	12,276,000
なとり	5,300	2,097.000	11,114,100
ピクルスコーポレーション	5,000	1,156.000	5,780,000
ファーマフーズ	10,900	1,463.000	15,946,700
ユーグレナ	46,100	954.000	43,979,400
紀文食品	7,700	1,020.000	7,854,000
ミヨシ油脂	1,300	1,018.000	1,323,400
理研ビタミン	6,300	1,735.000	10,930,500
片倉工業	8,500	2,014.000	17,119,000
ゲンゼ	4,900	3,900.000	19,110,000
東洋紡	35,000	1,041.000	36,435,000
ユニチカ	32,200	231.000	7,438,200
富士紡ホールディングス	3,700	3,520.000	13,024,000
倉敷紡績	6,400	2,066.000	13,222,400
シキボウ	8,600	905.000	7,783,000
日本毛織	20,800	1,046.000	21,756,800
帝国繊維	8,300	1,702.000	14,126,600
帝人	73,900	1,429.000	105,603,100
東レ	516,600	738.100	381,302,460
アツギ	15,000	454.000	6,810,000
ダイニック	3,300	629.000	2,075,700

セーレン	15,400	2,058.000	31,693,200
小松マテーレ	13,100	1,032.000	13,519,200
ワコールホールディングス	17,300	2,182.000	37,748,600
ホギメディカル	10,500	3,525.000	37,012,500
T S Iホールディングス	28,600	339.000	9,695,400
ワールド	11,600	1,368.000	15,868,800
三陽商会	5,400	871.000	4,703,400
オンワードホールディングス	52,100	253.000	13,181,300
ゴールドウイン	13,700	8,490.000	116,313,000
デサント	14,200	2,970.000	42,174,000
特種東海製紙	4,800	3,180.000	15,264,000
王子ホールディングス	319,900	558.000	178,504,200
日本製紙	34,100	974.000	33,213,400
北越コーポレーション	50,000	720.000	36,000,000
大王製紙	35,900	1,456.000	52,270,400
レンゴー	65,900	772.000	50,874,800
トーモク	5,100	1,524.000	7,772,400
ザ・バック	5,600	2,446.000	13,697,600
北の達人コーポレーション	33,100	223.000	7,381,300
クラレ	112,300	1,081.000	121,396,300
旭化成	512,400	1,077.500	552,111,000
昭和電工	68,200	2,247.000	153,245,400
住友化学	564,100	531.000	299,537,100
住友精化	3,500	3,040.000	10,640,000
日産化学	37,300	6,860.000	255,878,000
ラサ工業	3,500	1,950.000	6,825,000
クレハ	5,900	10,410.000	61,419,000
多木化学	2,800	4,710.000	13,188,000
テイカ	4,900	1,223.000	5,992,700
石原産業	15,200	1,072.000	16,294,400
日本曹達	9,100	4,280.000	38,948,000
東ソー	102,100	1,729.000	176,530,900
トクヤマ	25,200	1,804.000	45,460,800
セントラル硝子	12,500	3,290.000	41,125,000
東亜合成	35,600	1,074.000	38,234,400
大阪ソーダ	6,300	3,430.000	21,609,000
関東電化工業	16,100	925.000	14,892,500
デンカ	28,000	3,465.000	97,020,000
信越化学工業	131,500	17,445.000	2,294,017,500
日本カーバイド工業	4,300	1,386.000	5,959,800
堺化学工業	5,700	1,951.000	11,120,700
第一稀元素化学工業	7,900	1,216.000	9,606,400
エア・ウォーター	66,300	1,824.000	120,931,200
日本酸素ホールディングス	67,700	2,408.000	163,021,600
日本化学工業	3,000	2,080.000	6,240,000
日本パーカライジング	33,500	977.000	32,729,500
高圧ガス工業	12,200	689.000	8,405,800
四国化成工業	9,300	1,252.000	11,643,600

ステラ ケミファ	4,500	2,559.000	11,515,500
保土谷化学工業	2,500	3,575.000	8,937,500
日本触媒	11,700	5,340.000	62,478,000
大日精化工業	6,100	1,824.000	11,126,400
カネカ	17,600	3,675.000	64,680,000
三菱瓦斯化学	65,000	1,957.000	127,205,000
三井化学	64,200	2,828.000	181,557,600
J S R	77,300	3,770.000	291,421,000
東京応化工業	12,400	7,250.000	89,900,000
大阪有機化学工業	5,400	2,526.000	13,640,400
三菱ケミカルグループ	516,300	753.900	389,238,570
K Hネオケム	11,700	2,581.000	30,197,700
ダイセル	111,900	859.000	96,122,100
住友ベークライト	11,700	4,365.000	51,070,500
積水化学工業	157,300	1,903.000	299,341,900
日本ゼオン	62,100	1,390.000	86,319,000
アイカ工業	19,600	3,125.000	61,250,000
U B E	39,100	2,096.000	81,953,600
積水樹脂	10,900	1,751.000	19,085,900
タキロンシーアイ	17,700	561.000	9,929,700
旭有機材	4,900	2,278.000	11,162,200
ニチバン	4,900	1,671.000	8,187,900
リケンテクノス	16,700	493.000	8,233,100
大倉工業	3,700	1,782.000	6,593,400
積水化成成品工業	9,000	418.000	3,762,000
群栄化学工業	2,000	2,561.000	5,122,000
ミライアル	4,100	1,824.000	7,478,400
ダイキョーニシカワ	17,800	561.000	9,985,800
森六ホールディングス	4,500	1,881.000	8,464,500
恵和	2,400	3,700.000	8,880,000
日本化薬	57,400	1,278.000	73,357,200
カーリットホールディングス	8,800	650.000	5,720,000
日本精化	5,500	2,035.000	11,192,500
扶桑化学工業	6,300	3,475.000	21,892,500
トリケミカル研究所	8,700	2,320.000	20,184,000
A D E K A	32,200	2,436.000	78,439,200
日油	23,800	5,290.000	125,902,000
ハリマ化成グループ	7,500	867.000	6,502,500
花王	175,200	5,749.000	1,007,224,800
第一工業製薬	3,300	2,350.000	7,755,000
石原ケミカル	4,600	1,295.000	5,957,000
ニイタカ	2,100	2,361.000	4,958,100
三洋化成工業	4,600	4,845.000	22,287,000
大日本塗料	12,400	735.000	9,114,000
日本ペイントホールディングス	311,600	1,038.000	323,440,800
関西ペイント	72,000	1,910.000	137,520,000
中国塗料	18,900	894.000	16,896,600
日本特殊塗料	5,600	991.000	5,549,600

藤倉化成	12,000	496.000	5,952,000
太陽ホールディングス	12,100	2,911.000	35,223,100
D I C	27,800	2,493.000	69,305,400
サカタインクス	15,400	1,007.000	15,507,800
東洋インキS Cホールディングス	13,200	1,958.000	25,845,600
T & K T O K A	7,600	898.000	6,824,800
富士フィルムホールディングス	148,900	7,595.000	1,130,895,500
資生堂	147,500	5,502.000	811,545,000
ライオン	85,600	1,544.000	132,166,400
高砂香料工業	4,800	2,667.000	12,801,600
マンダム	17,100	1,543.000	26,385,300
ミルボン	10,600	5,430.000	57,558,000
ファンケル	34,400	2,555.000	87,892,000
コーセー	14,400	11,870.000	170,928,000
コタ	6,100	1,584.000	9,662,400
ポーラ・オルビスホールディングス	36,400	1,553.000	56,529,200
ノエビアホールディングス	6,300	5,910.000	37,233,000
新日本製薬	4,600	1,627.000	7,484,200
エステー	6,300	1,570.000	9,891,000
コニシ	12,600	1,636.000	20,613,600
長谷川香料	14,500	3,135.000	45,457,500
小林製薬	21,600	8,880.000	191,808,000
荒川化学工業	6,900	1,018.000	7,024,200
メック	5,900	2,523.000	14,885,700
日本高純度化学	2,500	2,358.000	5,895,000
タカラバイオ	22,200	2,175.000	48,285,000
J C U	8,500	3,645.000	30,982,500
デクセリアルズ	22,100	3,765.000	83,206,500
アース製薬	6,500	5,390.000	35,035,000
北興化学工業	10,200	1,018.000	10,383,600
大成ラミック	5,200	2,749.000	14,294,800
クミアイ化学工業	28,400	999.000	28,371,600
日本農薬	16,100	694.000	11,173,400
アキレス	6,500	1,417.000	9,210,500
有沢製作所	12,600	1,067.000	13,444,200
日東電工	51,000	8,620.000	439,620,000
レック	11,600	729.000	8,456,400
三光合成	12,500	383.000	4,787,500
きもと	35,300	252.000	8,895,600
藤森工業	6,300	3,600.000	22,680,000
前澤化成工業	6,800	1,348.000	9,166,400
未来工業	3,400	1,560.000	5,304,000
J S P	5,400	1,466.000	7,916,400
エフピコ	15,900	3,295.000	52,390,500
天馬	6,500	2,382.000	15,483,000
信越ポリマー	14,700	1,368.000	20,109,600
東リ	29,100	207.000	6,023,700
ニフコ	28,200	3,200.000	90,240,000

バルカー	7,100	2,783.000	19,759,300
ユニ・チャーム	147,200	4,816.000	708,915,200
協和キリン	84,800	3,155.000	267,544,000
武田薬品工業	666,100	3,808.000	2,536,508,800
アステラス製薬	724,500	2,062.500	1,494,281,250
住友ファーマ	52,600	1,123.000	59,069,800
塩野義製薬	98,500	6,858.000	675,513,000
わかもと製薬	9,000	255.000	2,295,000
日本新薬	18,500	8,260.000	152,810,000
中外製薬	220,600	3,796.000	837,397,600
科研製薬	12,300	3,895.000	47,908,500
エーザイ	93,800	6,097.000	571,898,600
ロート製薬	40,400	3,995.000	161,398,000
小野薬品工業	163,400	3,620.000	591,508,000
久光製薬	17,800	3,520.000	62,656,000
持田製薬	9,500	3,400.000	32,300,000
参天製薬	148,100	1,081.000	160,096,100
扶桑薬品工業	3,400	2,170.000	7,378,000
ツムラ	24,200	3,170.000	76,714,000
キッセイ薬品工業	12,000	2,798.000	33,576,000
生化学工業	15,200	867.000	13,178,400
栄研化学	13,000	1,984.000	25,792,000
鳥居薬品	3,600	3,150.000	11,340,000
JCRファーマ	24,100	2,456.000	59,189,600
東和薬品	12,200	2,555.000	31,171,000
富士製薬工業	6,300	1,005.000	6,331,500
ゼリア新薬工業	12,800	2,182.000	27,929,600
第一三共	614,600	3,423.000	2,103,775,800
キョーリン製薬ホールディングス	15,400	1,828.000	28,151,200
大幸薬品	15,300	623.000	9,531,900
ダイト	5,600	2,725.000	15,260,000
大塚ホールディングス	161,300	4,738.000	764,239,400
大正製薬ホールディングス	16,700	5,330.000	89,011,000
ペプチドリーム	34,700	1,628.000	56,491,600
あすか製薬ホールディングス	8,700	1,093.000	9,509,100
サワイグループホールディングス	16,300	4,395.000	71,638,500
日本コークス工業	80,300	120.000	9,636,000
ニチレキ	9,100	1,406.000	12,794,600
ユシロ化学工業	11,700	910.000	10,647,000
富士石油	24,400	333.000	8,125,200
出光興産	85,900	3,415.000	293,348,500
E N E O Sホールディングス	1,274,500	514.600	655,857,700
コスモエネルギーホールディングス	33,500	4,015.000	134,502,500
横浜ゴム	39,900	1,963.000	78,323,700
TOYO TIRE	40,600	1,813.000	73,607,800
ブリヂストン	225,200	5,341.000	1,202,793,200
住友ゴム工業	69,400	1,218.000	84,529,200
藤倉コンポジット	7,900	899.000	7,102,100

オカモト	4,100	4,025.000	16,502,500
フコク	3,500	970.000	3,395,000
ニッタ	7,600	2,996.000	22,769,600
住友理工	16,400	594.000	9,741,600
三ツ星ベルト	10,400	3,260.000	33,904,000
バンドー化学	13,600	973.000	13,232,800
日東紡績	10,900	2,451.000	26,715,900
A G C	71,800	4,805.000	344,999,000
日本電気硝子	29,200	2,511.000	73,321,200
オハラ	6,000	1,252.000	7,512,000
住友大阪セメント	13,300	3,495.000	46,483,500
太平洋セメント	48,700	2,001.000	97,448,700
日本ヒューム	9,700	665.000	6,450,500
日本コンクリート工業	23,800	277.000	6,592,600
三谷セキサン	4,200	3,920.000	16,464,000
アジアパイルホールディングス	16,100	492.000	7,921,200
東海カーボン	59,900	1,078.000	64,572,200
日本カーボン	4,300	4,140.000	17,802,000
東洋炭素	4,600	3,040.000	13,984,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,300	4,270.000	18,361,000
T O T O	51,100	4,830.000	246,813,000
日本碍子	83,000	1,930.000	160,190,000
日本特殊陶業	59,300	2,660.000	157,738,000
M A R U W A	2,900	17,250.000	50,025,000
品川リフラクトリーズ	2,200	3,785.000	8,327,000
黒崎播磨	1,700	4,675.000	7,947,500
ヨータイ	5,200	1,543.000	8,023,600
東京窯業	27,100	281.000	7,615,100
フジミインコーポレーテッド	6,800	6,090.000	41,412,000
ニチアス	17,500	2,397.000	41,947,500
ニチハ	10,700	2,776.000	29,703,200
日本製鉄	349,800	2,003.500	700,824,300
神戸製鋼所	145,900	623.000	90,895,700
中山製鋼所	14,100	459.000	6,471,900
合同製鐵	4,700	1,493.000	7,017,100
J F Eホールディングス	193,200	1,505.000	290,766,000
東京製鐵	24,400	1,402.000	34,208,800
共英製鋼	8,000	1,449.000	11,592,000
大和工業	13,400	4,640.000	62,176,000
東京鐵鋼	4,400	1,297.000	5,706,800
大阪製鐵	7,100	1,372.000	9,741,200
淀川製鋼所	8,400	2,405.000	20,202,000
丸一鋼管	23,900	2,980.000	71,222,000
モリ工業	3,900	2,645.000	10,315,500
大同特殊鋼	11,300	3,970.000	44,861,000
日本冶金工業	6,300	2,275.000	14,332,500
山陽特殊製鋼	7,000	1,965.000	13,755,000
愛知製鋼	5,000	2,200.000	11,000,000

日立金属	89,900	2,046.000	183,935,400
大太平洋金属	5,500	2,343.000	12,886,500
新日本電工	48,400	368.000	17,811,200
栗本鐵工所	3,900	1,684.000	6,567,600
三菱製鋼	7,000	988.000	6,916,000
日本精線	1,500	4,535.000	6,802,500
新家工業	6,200	1,452.000	9,002,400
大紀アルミニウム工業所	10,600	1,278.000	13,546,800
日本軽金属ホールディングス	21,900	1,623.000	35,543,700
三井金属鉱業	22,700	3,195.000	72,526,500
東邦亜鉛	4,900	2,200.000	10,780,000
三菱マテリアル	48,900	2,031.000	99,315,900
住友金属鉱山	92,000	4,299.000	395,508,000
DOWAホールディングス	19,500	4,870.000	94,965,000
古河機械金属	12,200	1,245.000	15,189,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,000	2,909.000	29,090,000
東邦チタニウム	15,200	2,330.000	35,416,000
U A C J	11,300	2,273.000	25,684,900
C Kサンエツ	1,600	4,195.000	6,712,000
古河電気工業	24,500	2,353.000	57,648,500
住友電気工業	291,700	1,503.000	438,425,100
フジクラ	93,500	804.000	75,174,000
昭和電線ホールディングス	7,600	1,783.000	13,550,800
タツタ電線	14,900	460.000	6,854,000
平河ヒューテック	4,900	1,126.000	5,517,400
リョービ	8,500	1,150.000	9,775,000
アーレスティ	12,000	387.000	4,644,000
アサヒホールディングス	33,700	2,096.000	70,635,200
稲葉製作所	10,400	1,323.000	13,759,200
宮地エンジニアリンググループ	2,700	3,320.000	8,964,000
トーカロ	21,100	1,297.000	27,366,700
アルファ	8,800	1,024.000	9,011,200
SUMCO	138,400	1,866.000	258,254,400
川田テクノロジーズ	1,900	3,720.000	7,068,000
R S TECHNOLOGIES	2,400	6,380.000	15,312,000
信和	17,600	825.000	14,520,000
東洋製罐グループホールディングス	42,800	1,600.000	68,480,000
ホッカンホールディングス	5,800	1,275.000	7,395,000
横河ブリッジホールディングス	11,700	1,915.000	22,405,500
三和ホールディングス	78,500	1,433.000	112,490,500
文化シャッター	24,300	1,034.000	25,126,200
三協立山	11,100	651.000	7,226,100
アルインコ	7,500	906.000	6,795,000
L I X I L	131,600	2,562.000	337,159,200
ノーリツ	10,800	1,494.000	16,135,200
長府製作所	7,200	1,866.000	13,435,200
リンナイ	14,500	10,080.000	146,160,000
日東精工	11,200	532.000	5,958,400

岡部	13,500	633.000	8,545,500
ジーテクト	8,300	1,354.000	11,238,200
東プレ	12,300	1,051.000	12,927,300
高周波熱錬	14,300	685.000	9,795,500
東京製網	6,100	943.000	5,752,300
サンコール	8,800	634.000	5,579,200
パイオラックス	11,000	2,014.000	22,154,000
エイチワン	1,400	630.000	882,000
日本発条	70,100	931.000	65,263,100
三益半導体工業	6,300	2,164.000	13,633,200
日本製鋼所	21,700	3,160.000	68,572,000
三浦工業	33,100	3,285.000	108,733,500
タクマ	24,400	1,439.000	35,111,600
ツガミ	17,500	1,274.000	22,295,000
オークマ	8,000	5,270.000	42,160,000
芝浦機械	9,700	3,150.000	30,555,000
アマダ	131,000	1,083.000	141,873,000
アイダエンジニアリング	18,100	928.000	16,796,800
F U J I	33,300	2,097.000	69,830,100
牧野フライス製作所	8,500	4,500.000	38,250,000
オーエスジー	34,200	1,870.000	63,954,000
旭ダイヤモンド工業	21,500	652.000	14,018,000
D M G 森精機	43,300	1,821.000	78,849,300
ソディック	21,300	839.000	17,870,700
ディスコ	12,400	32,900.000	407,960,000
日東工器	4,600	1,634.000	7,516,400
日進工具	6,600	1,306.000	8,619,600
パンチ工業	10,300	472.000	4,861,600
豊和工業	6,800	882.000	5,997,600
東洋機械金属	8,000	565.000	4,520,000
島精機製作所	12,100	2,295.000	27,769,500
オプトラン	10,900	1,922.000	20,949,800
N C ホールディングス	3,300	2,198.000	7,253,400
イワキ	6,400	1,016.000	6,502,400
フリーー	8,600	1,106.000	9,511,600
ヤマシンフィルタ	17,000	338.000	5,746,000
日阪製作所	9,700	852.000	8,264,400
やまびこ	12,200	1,227.000	14,969,400
野村マイクロ・サイエンス	2,800	3,685.000	10,318,000
平田機工	3,800	4,770.000	18,126,000
ベガサスミシン製造	10,400	787.000	8,184,800
マルマエ	4,200	2,061.000	8,656,200
タツモ	5,200	1,276.000	6,635,200
ナブテスコ	44,800	3,315.000	148,512,000
レオン自動機	9,400	1,325.000	12,455,000
S M C	24,800	67,320.000	1,669,536,000
ホソカワミクロン	5,500	2,777.000	15,273,500
ユニオンツール	3,000	3,395.000	10,185,000

オイレス工業	11,000	1,609.000	17,699,000
日精エー・エス・ビー機械	3,400	3,680.000	12,512,000
サトーホールディングス	11,200	2,010.000	22,512,000
技研製作所	7,500	3,380.000	25,350,000
日本エアータック	5,500	1,060.000	5,830,000
日精樹脂工業	6,800	946.000	6,432,800
オカダアイヨン	4,100	1,488.000	6,100,800
ワイエイシイホールディングス	4,100	1,598.000	6,551,800
小松製作所	384,100	2,978.500	1,144,041,850
住友重機械工業	45,100	3,065.000	138,231,500
日立建機	33,900	2,890.000	97,971,000
日工	13,300	663.000	8,817,900
巴工業	3,600	2,465.000	8,874,000
井関農機	8,200	1,222.000	10,020,400
TOWA	7,700	1,818.000	13,998,600
ローツェ	4,200	8,570.000	35,994,000
クボタ	379,000	2,259.500	856,350,500
荏原実業	3,700	2,338.000	8,650,600
三菱化工機	3,400	2,111.000	7,177,400
月島機械	14,500	912.000	13,224,000
帝国電機製作所	5,800	1,801.000	10,445,800
新東工業	16,900	732.000	12,370,800
澁谷工業	6,600	2,536.000	16,737,600
アイチコーポレーション	12,300	864.000	10,627,200
小森コーポレーション	20,200	808.000	16,321,600
鶴見製作所	6,400	2,072.000	13,260,800
住友精密工業	2,900	2,775.000	8,047,500
酒井重工業	2,100	2,969.000	6,234,900
荏原製作所	29,000	5,250.000	152,250,000
西島製作所	8,400	1,360.000	11,424,000
北越工業	8,200	939.000	7,699,800
ダイキン工業	92,500	23,720.000	2,194,100,000
オルガノ	2,400	9,380.000	22,512,000
トーヨーカネツ	3,600	2,755.000	9,918,000
栗田工業	42,700	5,500.000	234,850,000
椿本チエイン	10,800	3,155.000	34,074,000
大同工業	9,900	784.000	7,761,600
木村化工機	10,300	751.000	7,735,300
アネスト岩田	13,900	980.000	13,622,000
ダイフク	39,900	8,680.000	346,332,000
サムコ	2,600	2,845.000	7,397,000
タダノ	41,500	988.000	41,002,000
フジテック	26,100	2,897.000	75,611,700
C K D	21,400	1,903.000	40,724,200
平和	24,100	2,106.000	50,754,600
理想科学工業	7,300	2,375.000	17,337,500
SANKYO	17,800	4,215.000	75,027,000
日本金銭機械	10,500	697.000	7,318,500

マースグループホールディングス	6,200	1,625.000	10,075,000
フクシマガリレイ	5,200	3,690.000	19,188,000
ダイコク電機	5,200	1,280.000	6,656,000
竹内製作所	13,000	2,555.000	33,215,000
アマノ	22,400	2,584.000	57,881,600
J U K I	13,200	770.000	10,164,000
ジャノメ	8,800	750.000	6,600,000
マックス	10,000	1,889.000	18,890,000
グローリー	20,800	2,234.000	46,467,200
新晃工業	8,200	1,698.000	13,923,600
大和冷機工業	12,000	1,127.000	13,524,000
セガサミーホールディングス	76,400	2,283.000	174,421,200
日本ピストンリング	5,200	1,280.000	6,656,000
リケン	3,800	2,401.000	9,123,800
T P R	9,900	1,273.000	12,602,700
ツバキ・ナカシマ	18,700	972.000	18,176,400
ホシザキ	45,700	4,065.000	185,770,500
大豊工業	8,300	707.000	5,868,100
日本精工	145,300	756.000	109,846,800
N T N	158,500	252.000	39,942,000
ジェイテクト	71,500	1,000.000	71,500,000
不二越	6,100	3,760.000	22,936,000
日本トムソン	21,200	545.000	11,554,000
T H K	41,100	2,834.000	116,477,400
前澤給装工業	6,600	924.000	6,098,400
イーグル工業	9,900	1,024.000	10,137,600
日本ピラー工業	7,400	2,773.000	20,520,200
キッツ	27,700	712.000	19,722,400
マキタ	95,900	3,308.000	317,237,200
日立造船	67,900	834.000	56,628,600
三菱重工業	124,500	5,060.000	629,970,000
I H I	53,000	3,550.000	188,150,000
スター精密	14,000	1,732.000	24,248,000
日清紡ホールディングス	58,800	1,060.000	62,328,000
イビデン	40,800	4,035.000	164,628,000
コニカミノルタ	171,500	476.000	81,634,000
ブラザー工業	96,100	2,523.000	242,460,300
ミネベアミツミ	134,300	2,432.000	326,617,600
日立製作所	407,500	6,614.000	2,695,205,000
東芝	148,300	5,424.000	804,379,200
三菱電機	790,200	1,395.000	1,102,329,000
富士電機	47,000	5,970.000	280,590,000
安川電機	84,100	4,760.000	400,316,000
シンフォニア テクノロジー	9,500	1,469.000	13,955,500
明電舎	12,300	2,111.000	25,965,300
オリジン	1,500	1,229.000	1,843,500
山洋電気	3,200	5,370.000	17,184,000
デンヨー	6,600	1,686.000	11,127,600

PHCホールディングス	13,400	1,659.000	22,230,600
東芝テック	9,100	4,460.000	40,586,000
芝浦メカトロニクス	1,500	10,020.000	15,030,000
マブチモーター	17,600	3,805.000	66,968,000
日本電産	188,300	9,444.000	1,778,305,200
トレックス・セミコンダクター	4,000	2,770.000	11,080,000
東光高岳	5,300	1,969.000	10,435,700
ダブル・スコープ	23,600	1,846.000	43,565,600
ダイヘン	7,900	4,240.000	33,496,000
ヤーマン	14,300	1,563.000	22,350,900
JVCケンウッド	79,900	189.000	15,101,100
ミマキエンジニアリング	9,500	620.000	5,890,000
IPEX	5,200	1,350.000	7,020,000
日新電機	19,300	1,551.000	29,934,300
大崎電気工業	18,300	526.000	9,625,800
オムロン	70,600	7,709.000	544,255,400
日東工業	10,700	2,630.000	28,141,000
IDEC	10,600	2,932.000	31,079,200
ジーエス・ユアサコーポレーション	25,700	2,414.000	62,039,800
メルコホールディングス	2,500	3,550.000	8,875,000
日本電気	100,400	4,900.000	491,960,000
富士通	76,200	17,290.000	1,317,498,000
沖電気工業	34,300	774.000	26,548,200
電気興業	4,400	2,502.000	11,008,800
サンケン電気	7,300	5,190.000	37,887,000
アイホン	4,500	1,890.000	8,505,000
ルネサスエレクトロニクス	462,300	1,283.000	593,130,900
セイコーエプソン	94,600	1,999.000	189,105,400
ワコム	64,900	855.000	55,489,500
アルバック	17,000	5,110.000	86,870,000
アクセル	6,500	890.000	5,785,000
EIZO	5,900	3,715.000	21,918,500
日本信号	18,100	985.000	17,828,500
京三製作所	18,800	444.000	8,347,200
能美防災	9,400	1,875.000	17,625,000
ホーチキ	5,900	1,340.000	7,906,000
エレコム	19,600	1,692.000	33,163,200
パナソニックホールディングス	903,600	1,118.000	1,010,224,800
シャープ	80,800	1,060.000	85,648,000
アンリツ	54,600	1,637.000	89,380,200
富士通ゼネラル	23,200	2,816.000	65,331,200
ソニーグループ	530,800	11,320.000	6,008,656,000
TDK	122,600	4,185.000	513,081,000
帝国通信工業	4,600	1,487.000	6,840,200
タムラ製作所	32,200	630.000	20,286,000
アルプスアルパイン	69,100	1,193.000	82,436,300
日本電波工業	9,500	1,184.000	11,248,000
鈴木	3,000	807.000	2,421,000

メイコー	9,300	3,250.000	30,225,000
日本トリム	2,300	2,479.000	5,701,700
ローランド ディー . ジー .	4,100	3,375.000	13,837,500
フォスター電機	10,400	711.000	7,394,400
S M K	2,600	2,250.000	5,850,000
ヨコオ	6,100	1,994.000	12,163,400
ホシデン	19,000	1,458.000	27,702,000
ヒロセ電機	11,700	19,080.000	223,236,000
日本航空電子工業	16,800	2,274.000	38,203,200
T O A	10,300	806.000	8,301,800
マクセル	16,000	1,359.000	21,744,000
古野電気	10,700	1,126.000	12,048,200
スミダコーポレーション	7,800	892.000	6,957,600
アイコム	3,000	2,627.000	7,881,000
リオン	3,200	2,122.000	6,790,400
横河電機	77,800	2,367.000	184,152,600
新電元工業	3,300	3,545.000	11,698,500
アズビル	49,100	4,125.000	202,537,500
東亜ディーケーケー	9,100	865.000	7,871,500
日本光電工業	32,700	3,020.000	98,754,000
チノー	3,900	1,690.000	6,591,000
共和電業	4,200	328.000	1,377,600
日本電子材料	6,100	1,740.000	10,614,000
堀場製作所	15,700	6,590.000	103,463,000
アドバンテスト	62,900	8,140.000	512,006,000
エスベック	6,800	1,854.000	12,607,200
キーエンス	76,800	54,770.000	4,206,336,000
日置電機	3,700	6,750.000	24,975,000
シスメックス	60,800	9,446.000	574,316,800
日本マイクロニクス	12,200	1,280.000	15,616,000
メガチップス	7,700	3,320.000	25,564,000
O B A R A G R O U P	5,200	3,075.000	15,990,000
コーセル	10,400	866.000	9,006,400
イリソ電子工業	7,300	3,100.000	22,630,000
オブテックスグループ	13,100	2,105.000	27,575,500
千代田インテグレ	5,200	2,162.000	11,242,400
レーザーテック	34,800	18,785.000	653,718,000
スタンレー電気	54,500	2,450.000	133,525,000
岩崎電気	3,300	2,624.000	8,659,200
ウシオ電機	40,200	1,864.000	74,932,800
エノモト	2,500	1,591.000	3,977,500
日本セラミック	7,400	2,112.000	15,628,800
遠藤照明	6,100	772.000	4,709,200
古河電池	6,300	1,221.000	7,692,300
双信電機	8,800	482.000	4,241,600
山一電機	6,400	1,865.000	11,936,000
図研	5,600	3,460.000	19,376,000
日本電子	16,200	6,060.000	98,172,000

カシオ計算機	52,400	1,300.000	68,120,000
ファナック	74,400	23,120.000	1,720,128,000
日本シイエムケイ	18,200	461.000	8,390,200
エンプラス	2,300	3,480.000	8,004,000
大真空	11,700	946.000	11,068,200
ローム	35,200	9,870.000	347,424,000
浜松ホトニクス	56,200	6,150.000	345,630,000
三井ハイテック	7,300	9,030.000	65,919,000
新光電気工業	24,900	3,535.000	88,021,500
京セラ	119,100	7,318.000	871,573,800
太陽誘電	37,700	4,730.000	178,321,000
村田製作所	231,100	7,791.000	1,800,500,100
双葉電子工業	17,100	688.000	11,764,800
北陸電気工業	4,800	1,127.000	5,409,600
ニチコン	22,900	1,290.000	29,541,000
日本ケミコン	7,300	1,732.000	12,643,600
K O A	12,100	2,094.000	25,337,400
市光工業	12,400	374.000	4,637,600
小糸製作所	41,900	4,495.000	188,340,500
ミツバ	14,800	429.000	6,349,200
S C R E E Nホールディングス	13,400	9,700.000	129,980,000
キャノン電子	8,200	1,667.000	13,669,400
キャノン	386,100	3,139.000	1,211,967,900
リコー	202,000	1,072.000	216,544,000
象印マホービン	20,800	1,508.000	31,366,400
東京エレクトロン	53,800	46,600.000	2,507,080,000
トヨタ紡織	29,500	1,949.000	57,495,500
ユニプレス	15,600	844.000	13,166,400
豊田自動織機	59,700	7,960.000	475,212,000
モリタホールディングス	14,200	1,372.000	19,482,400
三櫻工業	12,800	709.000	9,075,200
デンソー	165,700	7,573.000	1,254,846,100
東海理化電機製作所	21,600	1,474.000	31,838,400
川崎重工業	57,800	2,705.000	156,349,000
日本車輛製造	3,500	2,124.000	7,434,000
三菱ロジスネクスト	14,200	915.000	12,993,000
日産自動車	1,000,700	519.000	519,363,300
いすゞ自動車	244,900	1,490.000	364,901,000
トヨタ自動車	3,862,800	2,212.000	8,544,513,600
日野自動車	106,800	730.000	77,964,000
三菱自動車工業	315,400	476.000	150,130,400
エフテック	8,400	542.000	4,552,800
武蔵精密工業	19,000	1,455.000	27,645,000
日産車体	12,700	657.000	8,343,900
新明和工業	23,200	1,057.000	24,522,400
極東開発工業	13,700	1,460.000	20,002,000
トピー工業	7,300	1,355.000	9,891,500
ティラド	2,900	2,626.000	7,615,400

曙ブレーキ工業	57,900	156.000	9,032,400
タチエス	15,000	1,172.000	17,580,000
N O K	32,300	1,200.000	38,760,000
フタバ産業	21,300	373.000	7,944,900
K Y B	7,600	3,130.000	23,788,000
大同メタル工業	20,800	554.000	11,523,200
プレス工業	40,300	411.000	16,563,300
ミクニ	15,200	355.000	5,396,000
太平洋工業	16,500	1,051.000	17,341,500
アイシン	61,700	4,065.000	250,810,500
マツダ	249,700	1,150.000	287,155,000
本田技研工業	619,400	3,476.000	2,153,034,400
スズキ	168,100	4,400.000	739,640,000
S U B A R U	223,200	2,347.500	523,962,000
ヤマハ発動機	110,400	2,588.000	285,715,200
T B K	18,500	338.000	6,253,000
エクセディ	13,200	1,741.000	22,981,200
豊田合成	24,100	2,222.000	53,550,200
愛三工業	14,400	705.000	10,152,000
日本プラスト	21,700	461.000	10,003,700
ヨロズ	8,500	896.000	7,616,000
エフ・シー・シー	13,900	1,436.000	19,960,400
シマノ	28,800	23,050.000	663,840,000
テイ・エス テック	36,000	1,521.000	54,756,000
テルモ	239,700	4,513.000	1,081,766,100
日機装	18,500	850.000	15,725,000
日本エム・ディ・エム	5,200	1,564.000	8,132,800
島津製作所	100,900	4,770.000	481,293,000
J M S	4,000	578.000	2,312,000
長野計器	6,400	1,209.000	7,737,600
ブイ・テクノロジー	4,100	2,990.000	12,259,000
東京計器	6,600	1,387.000	9,154,200
愛知時計電機	4,000	1,468.000	5,872,000
インターアクション	4,600	1,941.000	8,928,600
東京精密	13,200	4,645.000	61,314,000
マニー	31,400	1,618.000	50,805,200
ニコン	119,700	1,517.000	181,584,900
トプコン	40,100	1,893.000	75,909,300
オリンパス	406,100	2,797.000	1,135,861,700
理研計器	5,600	4,175.000	23,380,000
タムロン	5,200	2,857.000	14,856,400
H O Y A	163,600	13,800.000	2,257,680,000
ノーリツ鋼機	6,900	2,419.000	16,691,100
A & D ホロンホールディングス	9,500	983.000	9,338,500
朝日インテック	93,100	2,540.000	236,474,000
シチズン時計	83,000	589.000	48,887,000
リズム	3,300	1,576.000	5,200,800
メニコン	26,200	3,400.000	89,080,000

松風	3,400	1,819.000	6,184,600
セイコーホールディングス	12,000	2,933.000	35,196,000
ニプロ	60,300	1,177.000	70,973,100
スノーピーク	12,300	2,768.000	34,046,400
パラマウントベッドホールディングス	16,000	2,508.000	40,128,000
トランザクション	6,200	1,150.000	7,130,000
ニホンフラッシュ	7,200	989.000	7,120,800
前田工織	7,700	3,155.000	24,293,500
永大産業	30,800	263.000	8,100,400
アートネイチャー	8,200	770.000	6,314,000
バンダイナムコホールディングス	70,100	10,280.000	720,628,000
SHOEI	7,400	5,720.000	42,328,000
フランスベッドホールディングス	12,500	921.000	11,512,500
パイロットコーポレーション	11,000	5,140.000	56,540,000
萩原工業	5,500	1,119.000	6,154,500
フジシールインターナショナル	17,500	1,565.000	27,387,500
タカラトミー	35,100	1,479.000	51,912,900
広済堂ホールディングス	5,900	1,107.000	6,531,300
プロネクサス	7,000	1,160.000	8,120,000
ウッドワン	5,900	1,177.000	6,944,300
大建工業	4,700	1,963.000	9,226,100
凸版印刷	109,600	2,284.000	250,326,400
大日本印刷	91,300	2,928.000	267,326,400
共同印刷	2,700	2,503.000	6,758,100
NISSHA	13,400	1,571.000	21,051,400
TAKARA & COMPANY	5,800	2,023.000	11,733,400
アシックス	65,000	2,556.000	166,140,000
ローランド	5,300	4,340.000	23,002,000
小松ウオール工業	2,500	1,933.000	4,832,500
ヤマハ	49,000	5,690.000	278,810,000
河合楽器製作所	2,300	2,889.000	6,644,700
クリナップ	8,900	626.000	5,571,400
ピジョン	45,500	1,898.000	86,359,000
キングジム	7,600	910.000	6,916,000
リンテック	16,000	2,371.000	37,936,000
イトーキ	17,000	404.000	6,868,000
任天堂	47,800	58,930.000	2,816,854,000
三菱鉛筆	9,900	1,401.000	13,869,900
タカラスタANDARD	13,000	1,347.000	17,511,000
コクヨ	33,600	1,813.000	60,916,800
ナカバヤシ	7,300	521.000	3,803,300
グローブライド	6,400	2,328.000	14,899,200
オカムラ	23,300	1,338.000	31,175,400
美津濃	7,000	2,499.000	17,493,000
東京電力ホールディングス	635,200	510.000	323,952,000
中部電力	237,900	1,426.000	339,245,400
関西電力	295,500	1,309.000	386,809,500
中国電力	122,900	850.000	104,465,000

北陸電力	73,700	516.000	38,029,200
東北電力	185,400	663.000	122,920,200
四国電力	71,200	836.000	59,523,200
九州電力	161,700	841.000	135,989,700
北海道電力	75,700	540.000	40,878,000
沖縄電力	19,200	1,166.000	22,387,200
電源開発	62,900	2,070.000	130,203,000
エフオン	6,600	545.000	3,597,000
イーレックス	11,100	2,424.000	26,906,400
レノバ	16,700	2,564.000	42,818,800
東京瓦斯	150,900	2,644.000	398,979,600
大阪瓦斯	142,200	2,395.000	340,569,000
東邦瓦斯	33,300	3,225.000	107,392,500
北海道瓦斯	4,900	1,638.000	8,026,200
広島ガス	6,700	327.000	2,190,900
西部ガスホールディングス	7,800	1,822.000	14,211,600
静岡ガス	15,500	948.000	14,694,000
メタウォーター	8,600	2,000.000	17,200,000
SBSホールディングス	6,100	2,805.000	17,110,500
東武鉄道	76,800	3,230.000	248,064,000
相鉄ホールディングス	25,400	2,435.000	61,849,000
東急	196,100	1,665.000	326,506,500
京浜急行電鉄	94,700	1,513.000	143,281,100
小田急電鉄	106,400	1,932.000	205,564,800
京王電鉄	37,200	5,180.000	192,696,000
京成電鉄	49,000	3,785.000	185,465,000
富士急行	8,700	4,200.000	36,540,000
新京成電鉄	4,000	3,110.000	12,440,000
東日本旅客鉄道	129,500	7,070.000	915,565,000
西日本旅客鉄道	90,500	4,954.000	448,337,000
東海旅客鉄道	59,700	15,930.000	951,021,000
西武ホールディングス	102,600	1,403.000	143,947,800
鴻池運輸	12,000	1,301.000	15,612,000
西日本鉄道	20,100	2,960.000	59,496,000
ハマキョウレックス	5,400	3,235.000	17,469,000
サカイ引越センター	3,800	5,330.000	20,254,000
近鉄グループホールディングス	75,100	4,545.000	341,329,500
阪急阪神ホールディングス	92,900	3,945.000	366,490,500
南海電気鉄道	33,800	2,772.000	93,693,600
京阪ホールディングス	31,400	3,435.000	107,859,000
神戸電鉄	2,800	3,390.000	9,492,000
名古屋鉄道	77,900	2,195.000	170,990,500
山陽電気鉄道	6,400	2,289.000	14,649,600
アルプス物流	5,400	1,145.000	6,183,000
ヤマトホールディングス	110,000	2,328.000	256,080,000
山九	19,400	4,340.000	84,196,000
丸全昭和運輸	5,400	3,335.000	18,009,000
センコーグループホールディングス	36,800	929.000	34,187,200

トナミホールディングス	1,600	3,650.000	5,840,000
ニッコンホールディングス	24,000	2,467.000	59,208,000
福山通運	10,100	3,135.000	31,663,500
セイノーホールディングス	43,000	1,125.000	48,375,000
神奈川中央交通	2,300	3,645.000	8,383,500
日立物流	15,500	8,610.000	133,455,000
丸和運輸機関	13,700	1,610.000	22,057,000
C & F ロジホールディングス	7,400	1,166.000	8,628,400
九州旅客鉄道	54,600	2,825.000	154,245,000
S Gホールディングス	134,300	2,320.000	311,576,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	26,000	7,650.000	198,900,000
日本郵船	66,800	10,720.000	716,096,000
商船三井	123,300	3,775.000	465,457,500
川崎汽船	24,700	10,090.000	249,223,000
NSユニテッド海運	3,800	4,680.000	17,784,000
明治海運	9,900	1,041.000	10,305,900
飯野海運	32,400	747.000	24,202,800
乾汽船	6,400	1,924.000	12,313,600
日本航空	171,400	2,369.000	406,046,600
ANAホールディングス	191,700	2,532.000	485,384,400
パスコ	4,000	1,322.000	5,288,000
トランコム	2,300	7,520.000	17,296,000
日新	6,500	1,672.000	10,868,000
三菱倉庫	19,500	3,650.000	71,175,000
三井倉庫ホールディングス	8,200	3,150.000	25,830,000
住友倉庫	23,600	2,100.000	49,560,000
澁澤倉庫	4,400	2,180.000	9,592,000
東陽倉庫	31,000	297.000	9,207,000
日本トランスシティ	14,700	506.000	7,438,200
川西倉庫	3,300	1,034.000	3,412,200
東洋埠頭	2,900	1,289.000	3,738,100
上組	38,100	2,709.000	103,212,900
キューソー流通システム	9,800	1,200.000	11,760,000
エーアイテイー	5,500	1,828.000	10,054,000
内外トランスライン	3,100	2,114.000	6,553,400
日本コンセプト	2,900	1,623.000	4,706,700
NEC ネットズエスアイ	27,100	1,798.000	48,725,800
クロスキャット	5,500	969.000	5,329,500
システナ	116,900	462.000	54,007,800
デジタルアーツ	4,600	6,740.000	31,004,000
日鉄ソリューションズ	14,200	3,925.000	55,735,000
キューブシステム	5,300	1,086.000	5,755,800
コア	3,900	1,528.000	5,959,200
手間いらず	1,200	5,100.000	6,120,000
ラクーンホールディングス	7,800	1,531.000	11,941,800
ソリトンシステムズ	4,900	1,365.000	6,688,500
ソフトクリエイティブホールディングス	3,800	4,250.000	16,150,000

T I S	72,400	3,830.000	277,292,000
グリー	39,600	842.000	33,343,200
コーエーテクモホールディングス	26,500	4,815.000	127,597,500
三菱総合研究所	3,500	4,390.000	15,365,000
ファインデックス	8,000	693.000	5,544,000
ブレインパッド	7,700	1,289.000	9,925,300
K L a b	15,700	466.000	7,316,200
ポルトゥウィンホールディングス	12,900	1,052.000	13,570,800
ネクソン	189,800	3,045.000	577,941,000
エムアップホールディングス	10,100	1,578.000	15,937,800
エイチーム	7,000	753.000	5,271,000
エニグモ	11,400	537.000	6,121,800
コロブラ	27,700	689.000	19,085,300
ブロードリーフ	44,100	469.000	20,682,900
デジタルハーツホールディングス	4,400	1,943.000	8,549,200
システム情報	7,000	1,005.000	7,035,000
メディアドゥ	3,300	2,133.000	7,038,900
じげん	27,100	341.000	9,241,100
ブイキューブ	9,300	1,395.000	12,973,500
ディー・エル・イー	8,600	399.000	3,431,400
フィックスターズ	8,800	1,178.000	10,366,400
C A R T A H O L D I N G S	4,000	1,974.000	7,896,000
オブティム	7,300	834.000	6,088,200
セレス	3,600	1,187.000	4,273,200
S H I F T	5,200	21,310.000	110,812,000
ティーガイア	7,600	1,645.000	12,502,000
テクマトリックス	14,600	1,928.000	28,148,800
プロシップ	3,200	1,634.000	5,228,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,000	2,603.000	57,266,000
G M O ペイメントゲートウェイ	16,200	11,220.000	181,764,000
システムリサーチ	2,700	2,160.000	5,832,000
インターネットイニシアティブ	22,100	5,410.000	119,561,000
さくらインターネット	11,600	584.000	6,774,400
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,300	5,960.000	13,708,000
S R A ホールディングス	4,400	2,969.000	13,063,600
朝日ネット	9,200	611.000	5,621,200
e B A S E	11,400	629.000	7,170,600
アバント	9,100	1,417.000	12,894,700
アドソル日進	3,800	1,750.000	6,650,000
フリービット	5,800	889.000	5,156,200
コムチュア	9,300	2,539.000	23,612,700
アステリア	7,300	875.000	6,387,500
アイル	4,100	1,690.000	6,929,000
マークラインズ	4,400	2,330.000	10,252,000
メディカル・データ・ビジョン	11,400	1,286.000	14,660,400
g u m i	13,500	666.000	8,991,000
テラスカイ	3,800	1,732.000	6,581,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,600	1,467.000	6,748,200

ネオジャパン	3,700	1,127.000	4,169,900
P R T I M E S	2,200	2,246.000	4,941,200
ラクス	38,400	1,899.000	72,921,600
ダブルスタンダード	3,000	2,044.000	6,132,000
オープンドア	5,400	1,795.000	9,693,000
アカツキ	4,200	2,671.000	11,218,200
U B I C O Mホールディングス	2,600	2,822.000	7,337,200
カナミックネットワーク	13,000	603.000	7,839,000
チェンジ	17,400	2,056.000	35,774,400
オークネット	4,100	2,387.000	9,786,700
エイトレッド	3,000	1,937.000	5,811,000
マクロミル	17,100	951.000	16,262,100
オロ	2,800	1,635.000	4,578,000
ユーザーローカル	3,100	1,629.000	5,049,900
マネーフォワード	14,600	3,555.000	51,903,000
電算システムホールディングス	3,800	2,444.000	9,287,200
プロトコーポレーション	9,500	1,118.000	10,621,000
野村総合研究所	144,500	4,160.000	601,120,000
サイバネットシステム	10,800	965.000	10,422,000
日本システム技術	1,900	2,813.000	5,344,700
インテージホールディングス	10,100	1,474.000	14,887,400
ソースネクスト	41,100	241.000	9,905,100
インフォコム	9,100	2,180.000	19,838,000
シンプレクス・ホールディングス	13,500	2,030.000	27,405,000
HEROZ	3,300	950.000	3,135,000
ラクスル	10,200	2,236.000	22,807,200
メルカリ	30,200	2,397.000	72,389,400
I P S	2,600	2,574.000	6,692,400
システムサポート	3,700	1,298.000	4,802,600
イーソル	5,600	673.000	3,768,800
アルテリア・ネットワークス	9,400	1,292.000	12,144,800
ウイングアーク1 s t	6,600	2,004.000	13,226,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	1,686.000	3,877,800
サーバーワークス	1,700	2,664.000	4,528,800
S a n s a n	27,100	1,386.000	37,560,600
ギフトィ	8,400	1,431.000	12,020,400
ベース	1,300	6,260.000	8,138,000
J M D C	10,500	6,950.000	72,975,000
フォーカスシステムズ	7,000	942.000	6,594,000
クレスコ	6,300	2,135.000	13,450,500
フジ・メディア・ホールディングス	73,800	1,148.000	84,722,400
オービック	26,100	21,460.000	560,106,000
ジャストシステム	11,900	4,120.000	49,028,000
T D Cソフト	6,900	1,203.000	8,300,700
Zホールディングス	1,200,800	480.300	576,744,240
トレンドマイクロ	40,900	7,720.000	315,748,000
日本オラクル	13,900	8,340.000	115,926,000

アルファシステムズ	2,200	4,990.000	10,978,000
フューチャー	17,500	1,688.000	29,540,000
C A C H O L D I N G S	4,500	1,461.000	6,574,500
S Bテクノロジー	4,000	2,519.000	10,076,000
オービックビジネスコンサルタント	7,900	4,555.000	35,984,500
伊藤忠テクノソリューションズ	37,800	3,585.000	135,513,000
アイティフォー	11,300	843.000	9,525,900
東計電算	1,500	6,430.000	9,645,000
大塚商会	40,000	4,190.000	167,600,000
サイボウズ	10,600	1,156.000	12,253,600
電通国際情報サービス	8,400	4,595.000	38,598,000
A C C E S S	10,800	816.000	8,812,800
デジタルガレージ	13,800	3,935.000	54,303,000
イーエムシステムズ	12,400	1,099.000	13,627,600
ウェザーニューズ	2,600	7,900.000	20,540,000
C I J	8,000	787.000	6,296,000
ビジネスエンジニアリング	2,200	2,785.000	6,127,000
WOWOW	4,600	1,444.000	6,642,400
スカラ	10,200	755.000	7,701,000
I M A G I C A G R O U P	7,000	833.000	5,831,000
ネットワンシステムズ	30,900	2,979.000	92,051,100
アルゴグラフィックス	6,400	3,530.000	22,592,000
マーベラス	14,800	700.000	10,360,000
エイベックス	15,300	1,546.000	23,653,800
B I P R O G Y	26,200	2,844.000	74,512,800
兼松エレクトロニクス	4,400	4,155.000	18,282,000
都築電気	4,400	1,347.000	5,926,800
T B Sホールディングス	40,300	1,694.000	68,268,200
日本テレビホールディングス	69,100	1,215.000	83,956,500
朝日放送グループホールディングス	10,600	657.000	6,964,200
テレビ朝日ホールディングス	19,900	1,495.000	29,750,500
スカパーJ S A Tホールディングス	71,200	544.000	38,732,800
テレビ東京ホールディングス	5,400	1,923.000	10,384,200
ビジョン	9,800	1,189.000	11,652,200
U S E N - N E X T H O L D I N G S	6,600	2,213.000	14,605,800
コネクシオ	5,700	1,328.000	7,569,600
日本通信	74,900	201.000	15,054,900
日本電信電話	931,900	3,801.000	3,542,151,900
K D D I	606,300	4,220.000	2,558,586,000
ソフトバンク	1,260,000	1,533.500	1,932,210,000
光通信	9,600	14,860.000	142,656,000
エムティーアイ	8,700	553.000	4,811,100
G M Oインターネット	26,500	2,656.000	70,384,000
ファイバーゲート	5,500	878.000	4,829,000
K A D O K A W A	45,000	3,130.000	140,850,000
学研ホールディングス	13,100	955.000	12,510,500
ゼンリン	13,600	930.000	12,648,000
アイネット	5,300	1,295.000	6,863,500

松竹	4,900	13,050.000	63,945,000
東宝	49,000	5,340.000	261,660,000
東映	2,300	19,340.000	44,482,000
エヌ・ティ・ティ・データ	220,600	2,019.000	445,391,400
ピー・シー・エー	5,500	1,230.000	6,765,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,700	1,418.000	5,246,600
D T S	14,900	3,400.000	50,660,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	38,700	6,080.000	235,296,000
シーイーシー	9,600	1,267.000	12,163,200
カプコン	78,300	3,695.000	289,318,500
アイ・エス・ビー	2,000	1,188.000	2,376,000
ジャステック	5,400	1,232.000	6,652,800
S C S K	57,200	2,260.000	129,272,000
日本システムウエア	3,300	2,455.000	8,101,500
アイネス	7,800	1,642.000	12,807,600
T K C	12,200	3,540.000	43,188,000
富士ソフト	7,900	8,160.000	64,464,000
N S D	25,400	2,506.000	63,652,400
コナミグループ	30,200	7,850.000	237,070,000
福井コンピュータホールディングス	3,900	3,510.000	13,689,000
J B C Cホールディングス	6,100	1,770.000	10,797,000
ミロク情報サービス	8,400	1,493.000	12,541,200
ソフトバンクグループ	498,800	5,504.000	2,745,395,200
高千穂交易	3,500	2,050.000	7,175,000
伊藤忠食品	1,700	5,040.000	8,568,000
エレマテック	6,800	1,277.000	8,683,600
あらた	6,200	4,200.000	26,040,000
トーメンデバイス	1,400	5,410.000	7,574,000
東京エレクトロン デバイス	2,500	5,230.000	13,075,000
フィールズ	8,300	1,043.000	8,656,900
双日	85,700	2,041.000	174,913,700
アルフレッサ ホールディングス	86,700	1,797.000	155,799,900
横浜冷凍	23,200	920.000	21,344,000
アルコニックス	11,500	1,330.000	15,295,000
神戸物産	57,600	3,880.000	223,488,000
あい ホールディングス	11,500	1,739.000	19,998,500
ダイワボウホールディングス	35,400	1,889.000	66,870,600
マクニカホールディングス	19,700	2,821.000	55,573,700
ラクト・ジャパン	3,300	2,450.000	8,085,000
グリムス	3,900	1,622.000	6,325,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,600	686.000	10,015,600
八洲電機	7,300	1,018.000	7,431,400
メディアスホールディングス	5,900	1,040.000	6,136,000
レスターホールディングス	7,700	1,970.000	15,169,000
ジューテックホールディングス	5,000	1,072.000	5,360,000
T O K A Iホールディングス	40,600	886.000	35,971,600
三洋貿易	7,900	1,029.000	8,129,100
ビューティガレージ	1,800	2,842.000	5,115,600

ウイン・パートナーズ	6,000	1,023.000	6,138,000
シップヘルスケアホールディングス	24,500	2,553.000	62,548,500
コメダホールディングス	19,400	2,316.000	44,930,400
フルサト・マルカホールディングス	7,500	3,005.000	22,537,500
ヤマエグループホールディングス	5,500	1,385.000	7,617,500
小野建	8,400	1,428.000	11,995,200
伯東	5,100	3,055.000	15,580,500
コンドーテック	7,400	1,051.000	7,777,400
ナガイレーベン	10,200	2,049.000	20,899,800
三菱食品	9,500	3,445.000	32,727,500
松田産業	6,300	2,063.000	12,996,900
第一興商	16,000	3,865.000	61,840,000
メディカルホールディングス	77,400	2,003.000	155,032,200
S P K	4,300	1,371.000	5,895,300
萩原電気ホールディングス	3,500	2,055.000	7,192,500
アズワン	12,000	6,690.000	80,280,000
スズデン	4,400	2,152.000	9,468,800
尾家産業	4,700	817.000	3,839,900
シモジマ	5,800	1,039.000	6,026,200
ドウシシャ	7,600	1,538.000	11,688,800
高速	4,500	1,506.000	6,777,000
丸文	8,400	750.000	6,300,000
ハピネット	6,900	1,627.000	11,226,300
日本ライフライン	25,700	1,070.000	27,499,000
タカショー	8,400	716.000	6,014,400
I D O M	26,300	813.000	21,381,900
進和	5,300	2,291.000	12,142,300
ダイトロン	3,400	1,936.000	6,582,400
シークス	11,000	990.000	10,890,000
オーハシテクニカ	5,300	1,394.000	7,388,200
白銅	3,100	2,533.000	7,852,300
伊藤忠商事	499,900	3,950.000	1,974,605,000
丸紅	723,100	1,272.000	919,783,200
高島	2,000	2,639.000	5,278,000
長瀬産業	37,300	2,012.000	75,047,600
蝶理	4,600	2,008.000	9,236,800
豊田通商	74,000	4,700.000	347,800,000
三共生興	16,200	507.000	8,213,400
兼松	28,400	1,394.000	39,589,600
三井物産	604,800	3,024.000	1,828,915,200
日本紙パルプ商事	4,000	4,175.000	16,700,000
カメイ	9,100	1,086.000	9,882,600
スターゼン	5,900	2,074.000	12,236,600
山善	29,100	1,023.000	29,769,300
椿本興業	1,500	3,710.000	5,565,000
住友商事	493,800	1,900.000	938,220,000
内田洋行	3,400	5,020.000	17,068,000
三菱商事	547,200	4,061.000	2,222,179,200

第一実業	3,600	3,380.000	12,168,000
キヤノンマーケティングジャパン	17,200	3,130.000	53,836,000
西華産業	4,300	1,665.000	7,159,500
佐藤商事	6,100	1,143.000	6,972,300
菱洋エレクトロ	5,600	2,234.000	12,510,400
東京産業	8,000	722.000	5,776,000
ユアサ商事	6,600	3,645.000	24,057,000
神鋼商事	2,000	3,875.000	7,750,000
阪和興業	14,300	2,965.000	42,399,500
正栄食品工業	5,100	4,010.000	20,451,000
カナデン	7,800	1,083.000	8,447,400
菱電商事	7,100	1,641.000	11,651,100
岩谷産業	18,600	5,620.000	104,532,000
ナイス	4,100	1,732.000	7,101,200
極東貿易	2,900	2,658.000	7,708,200
アステナホールディングス	14,000	440.000	6,160,000
三愛オブリ	18,700	1,074.000	20,083,800
稲畑産業	16,600	2,413.000	40,055,800
G S Iクレオス	5,100	1,449.000	7,389,900
明和産業	8,400	749.000	6,291,600
ワキタ	15,800	1,119.000	17,680,200
東邦ホールディングス	23,300	2,027.000	47,229,100
サンゲツ	20,600	1,625.000	33,475,000
ミツウロコグループホールディングス	12,900	960.000	12,384,000
シナネンホールディングス	2,900	3,770.000	10,933,000
伊藤忠エネクス	17,700	1,067.000	18,885,900
サンリオ	23,700	3,080.000	72,996,000
サンワ テクノス	4,900	1,432.000	7,016,800
リョーサン	8,700	2,208.000	19,209,600
新光商事	12,600	943.000	11,881,800
トーホー	4,100	1,259.000	5,161,900
三信電気	4,300	1,551.000	6,669,300
東陽テクニカ	9,200	1,237.000	11,380,400
モスフードサービス	11,200	3,475.000	38,920,000
加賀電子	6,700	3,270.000	21,909,000
ソーダニッカ	9,300	579.000	5,384,700
立花エレクトック	5,600	1,572.000	8,803,200
P A L T A C	11,700	4,240.000	49,608,000
三谷産業	17,300	311.000	5,380,300
太平洋興発	7,300	618.000	4,511,400
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,000	3,945.000	7,890,000
コーア商事ホールディングス	5,900	743.000	4,383,700
国際紙パルプ商事	17,100	500.000	8,550,000
ヤマタネ	4,900	1,599.000	7,835,100
日鉄物産	4,800	5,240.000	25,152,000
泉州電業	1,900	5,360.000	10,184,000
トラスコ中山	15,600	1,939.000	30,248,400
オートバックスセブン	27,200	1,428.000	38,841,600

モリト	7,300	754.000	5,504,200
加藤産業	8,800	3,350.000	29,480,000
イノテック	5,800	1,367.000	7,928,600
イエローハット	12,900	1,791.000	23,103,900
J Kホールディングス	6,400	1,005.000	6,432,000
日伝	5,800	2,017.000	11,698,600
杉本商事	4,000	2,087.000	8,348,000
因幡電機産業	20,000	2,810.000	56,200,000
東テク	2,600	3,315.000	8,619,000
ミスミグループ本社	104,700	3,680.000	385,296,000
タキヒヨー	6,000	824.000	4,944,000
スズケン	30,000	3,690.000	110,700,000
ジェコス	4,500	830.000	3,735,000
ローソン	18,700	4,805.000	89,853,500
サンエー	5,300	4,205.000	22,286,500
カワチ薬品	6,600	2,174.000	14,348,400
エービーシー・マート	12,900	5,660.000	73,014,000
ハードオフコーポレーション	5,600	998.000	5,588,800
アスクル	18,300	1,757.000	32,153,100
ゲオホールディングス	10,500	1,429.000	15,004,500
アダストリア	9,200	2,034.000	18,712,800
くら寿司	8,900	3,230.000	28,747,000
キャンドウ	4,700	2,209.000	10,382,300
パルグループホールディングス	7,400	2,300.000	17,020,000
エディオン	37,500	1,242.000	46,575,000
サーラコーポレーション	16,100	723.000	11,640,300
ハローズ	3,700	3,165.000	11,710,500
フジオフードグループ本社	7,100	1,370.000	9,727,000
あみやき亭	1,200	2,955.000	3,546,000
大黒天物産	2,700	5,310.000	14,337,000
ハニーズホールディングス	7,100	1,294.000	9,187,400
アルペン	6,200	2,117.000	13,125,400
クオールホールディングス	10,400	1,494.000	15,537,600
ジンスホールディングス	4,600	3,925.000	18,055,000
ビックカメラ	49,100	1,177.000	57,790,700
D C Mホールディングス	48,900	1,057.000	51,687,300
MonotaRO	105,500	2,537.000	267,653,500
アークランドサービスホールディングス	6,100	2,175.000	13,267,500
J . フロント リテイリング	93,000	1,109.000	103,137,000
ドトール・日レスホールディングス	12,800	1,683.000	21,542,400
マツキヨココカラ & カンパニー	48,800	5,100.000	248,880,000
ブロンコビリー	4,600	2,495.000	11,477,000
Z O Z O	57,600	3,160.000	182,016,000
トレジャー・ファクトリー	2,900	1,500.000	4,350,000
物語コーポレーション	4,200	5,790.000	24,318,000
三越伊勢丹ホールディングス	125,400	1,084.000	135,933,600
H a m e e	3,900	1,088.000	4,243,200
ウエルシアホールディングス	44,200	3,015.000	133,263,000

クリエイティブSDホールディングス	11,700	3,150.000	36,855,000
チムニー	9,900	1,230.000	12,177,000
シュッピン	7,500	1,456.000	10,920,000
オイシックス・ラ・大地	12,300	1,810.000	22,263,000
ネクステージ	17,000	3,060.000	52,020,000
ジョイフル本田	23,500	1,600.000	37,600,000
鳥貴族ホールディングス	3,600	2,290.000	8,244,000
ホットランド	7,200	1,350.000	9,720,000
すかいらくホールディングス	102,300	1,598.000	163,475,400
SFPホールディングス	4,400	1,771.000	7,792,400
綿半ホールディングス	6,100	1,443.000	8,802,300
ヨシックスホールディングス	2,100	2,283.000	4,794,300
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	27,800	1,105.000	30,719,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	1,701.000	6,633,900
B E E N O S	4,500	2,510.000	11,295,000
あさひ	6,700	1,321.000	8,850,700
日本調剤	5,600	1,417.000	7,935,200
コスモス薬品	8,500	14,540.000	123,590,000
セブン&アイ・ホールディングス	279,900	5,431.000	1,520,136,900
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	56,400	1,007.000	56,794,800
ツルハホールディングス	18,300	7,650.000	139,995,000
サンマルクホールディングス	7,600	1,639.000	12,456,400
フェリシモ	2,500	1,096.000	2,740,000
トリドールホールディングス	20,900	2,581.000	53,942,900
JMホールディングス	6,900	1,619.000	11,171,100
アレンザホールディングス	6,000	1,042.000	6,252,000
串カツ田中ホールディングス	3,700	1,985.000	7,344,500
パロックスジャパンリミテッド	6,400	827.000	5,292,800
クスリのアオキホールディングス	7,500	5,710.000	42,825,000
FOOD & LIFE COMPANIES	42,800	2,471.000	105,758,800
メディカルシステムネットワーク	9,300	451.000	4,194,300
ノジマ	13,300	2,913.000	38,742,900
カップ・クリエイティブ	12,100	1,484.000	17,956,400
ライトオン	4,000	750.000	3,000,000
良品計画	96,300	1,373.000	132,219,900
アドヴァングループ	14,000	819.000	11,466,000
アルビス	2,800	2,288.000	6,406,400
G - 7ホールディングス	9,100	1,517.000	13,804,700
イオン北海道	14,500	1,075.000	15,587,500
コジマ	14,200	680.000	9,656,000
コーナン商事	11,800	3,770.000	44,486,000
エコス	3,200	2,005.000	6,416,000
ワタミ	11,000	947.000	10,417,000
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	166,900	2,121.000	353,994,900
西松屋チェーン	16,600	1,636.000	27,157,600
ゼンショーホールディングス	40,500	3,585.000	145,192,500

幸楽苑ホールディングス	6,300	1,290.000	8,127,000
サイゼリヤ	12,800	2,706.000	34,636,800
V Tホールディングス	31,100	493.000	15,332,300
フジ・コーポレーション	4,700	1,270.000	5,969,000
ユナイテッドアローズ	9,100	1,791.000	16,298,100
ハイデイ日高	11,900	2,191.000	26,072,900
コロワイド	34,900	1,967.000	68,648,300
壱番屋	5,600	4,790.000	26,824,000
スギホールディングス	16,700	6,080.000	101,536,000
薬王堂ホールディングス	4,300	2,138.000	9,193,400
スクロール	13,200	818.000	10,797,600
ヨンドシーホールディングス	7,300	1,824.000	13,315,200
木曽路	11,900	2,312.000	27,512,800
S R Sホールディングス	15,600	893.000	13,930,800
千趣会	15,800	395.000	6,241,000
リテールパートナーズ	10,800	1,222.000	13,197,600
ケーヨー	15,900	994.000	15,804,600
上新電機	7,500	2,006.000	15,045,000
日本瓦斯	40,200	2,019.000	81,163,800
ロイヤルホールディングス	14,500	2,165.000	31,392,500
いなげや	8,100	1,282.000	10,384,200
チヨダ	9,600	805.000	7,728,000
ライフコーポレーション	6,500	2,630.000	17,095,000
リンガーハット	10,500	2,352.000	24,696,000
Mr Max HD	11,400	635.000	7,239,000
A O K Iホールディングス	15,900	664.000	10,557,600
オークワ	12,300	889.000	10,934,700
コメリ	12,500	2,726.000	34,075,000
青山商事	17,000	885.000	15,045,000
しまむら	9,700	12,760.000	123,772,000
高島屋	56,800	1,455.000	82,644,000
松屋	14,600	931.000	13,592,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	36,200	1,016.000	36,779,200
近鉄百貨店	5,100	2,365.000	12,061,500
丸井グループ	60,200	2,468.000	148,573,600
アクシアル リテイリング	5,300	3,485.000	18,470,500
イオン	275,300	2,732.000	752,119,600
イズミ	13,200	3,195.000	42,174,000
平和堂	11,700	2,028.000	23,727,600
フジ	18,300	2,195.000	40,168,500
ヤオコー	9,400	6,610.000	62,134,000
ゼビオホールディングス	11,000	926.000	10,186,000
ケーズホールディングス	70,900	1,357.000	96,211,300
O L Y M P I Cグループ	10,200	602.000	6,140,400
Genky DrugStores	3,800	3,440.000	13,072,000
ブックオフグループホールディングス	5,600	1,005.000	5,628,000
ギフトホールディングス	1,900	2,688.000	5,107,200
アインホールディングス	10,300	7,800.000	80,340,000

元気寿司	4,500	2,619.000	11,785,500
ヤマダホールディングス	295,600	477.000	141,001,200
アークランドサカモト	13,500	1,577.000	21,289,500
ニトリホールディングス	33,200	14,340.000	476,088,000
グルメ杵屋	8,900	1,062.000	9,451,800
ケーユーホールディングス	2,000	1,238.000	2,476,000
吉野家ホールディングス	29,600	2,598.000	76,900,800
松屋フーズホールディングス	3,900	4,055.000	15,814,500
サガミホールディングス	13,500	1,204.000	16,254,000
関西フードマーケット	8,100	1,284.000	10,400,400
王将フードサービス	5,200	7,030.000	36,556,000
プレナス	9,100	2,000.000	18,200,000
ミニストップ	7,400	1,477.000	10,929,800
アークス	14,100	2,152.000	30,343,200
パローホールディングス	16,300	1,894.000	30,872,200
ベルク	3,500	5,570.000	19,495,000
大 庄	9,800	1,199.000	11,750,200
ファーストリテイリング	11,200	80,020.000	896,224,000
サンドラッグ	31,400	3,145.000	98,753,000
サックスパー ホールディングス	9,900	633.000	6,266,700
やまや	1,000	2,662.000	2,662,000
ベルーナ	17,500	753.000	13,177,500
めぶきフィナンシャルグループ	345,300	270.000	93,231,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,800	2,215.000	21,707,000
九州フィナンシャルグループ	140,100	400.000	56,040,000
ゆうちょ銀行	196,200	1,070.000	209,934,000
富山第一銀行	20,200	421.000	8,504,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	411,600	452.000	186,043,200
西日本フィナンシャルホールディングス	44,300	755.000	33,446,500
三十三フィナンシャルグループ	7,600	1,414.000	10,746,400
第四北越フィナンシャルグループ	11,500	2,636.000	30,314,000
ひろぎんホールディングス	107,200	621.000	66,571,200
おきなわフィナンシャルグループ	7,500	2,270.000	17,025,000
十六フィナンシャルグループ	10,100	2,518.000	25,431,800
北國フィナンシャルホールディングス	7,000	4,730.000	33,110,000
プロクレアホールディングス	9,300	2,096.000	19,492,800
新生銀行	56,000	1,980.000	110,880,000
あおぞら銀行	46,400	2,791.000	129,502,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,887,500	749.000	3,660,737,500
りそなホールディングス	882,500	519.000	458,017,500
三井住友トラスト・ホールディングス	137,800	4,389.000	604,804,200
三井住友フィナンシャルグループ	541,500	4,162.000	2,253,723,000
千葉銀行	235,100	737.000	173,268,700
群馬銀行	134,200	386.000	51,801,200
武蔵野銀行	10,500	1,783.000	18,721,500
千葉興業銀行	23,300	258.000	6,011,400
筑波銀行	42,100	202.000	8,504,200
七十七銀行	22,100	1,804.000	39,868,400

秋田銀行	5,800	1,695.000	9,831,000
山形銀行	9,900	935.000	9,256,500
岩手銀行	5,600	1,989.000	11,138,400
東邦銀行	70,200	214.000	15,022,800
ふくおかフィナンシャルグループ	60,400	2,388.000	144,235,200
静岡銀行	170,300	808.000	137,602,400
スルガ銀行	75,300	377.000	28,388,100
八十二銀行	151,600	493.000	74,738,800
山梨中央銀行	10,100	1,155.000	11,665,500
大垣共立銀行	14,400	1,769.000	25,473,600
福井銀行	8,100	1,398.000	11,323,800
清水銀行	1,900	1,488.000	2,827,200
富山銀行	4,100	1,830.000	7,503,000
滋賀銀行	13,400	2,731.000	36,595,400
南都銀行	11,200	2,042.000	22,870,400
百五銀行	71,700	330.000	23,661,000
京都銀行	25,600	5,620.000	143,872,000
紀陽銀行	24,000	1,485.000	35,640,000
ほくほくフィナンシャルグループ	48,800	868.000	42,358,400
山陰合同銀行	46,800	685.000	32,058,000
中国銀行	57,400	989.000	56,768,600
伊予銀行	91,700	653.000	59,880,100
百十四銀行	9,300	1,720.000	15,996,000
四国銀行	13,800	849.000	11,716,200
阿波銀行	10,600	2,021.000	21,422,600
大分銀行	6,000	1,998.000	11,988,000
宮崎銀行	5,700	2,124.000	12,106,800
佐賀銀行	5,400	1,478.000	7,981,200
琉球銀行	21,700	807.000	17,511,900
セブン銀行	249,300	265.000	66,064,500
みずほフィナンシャルグループ	1,000,200	1,593.500	1,593,818,700
山口フィナンシャルグループ	84,500	757.000	63,966,500
名古屋銀行	5,300	3,085.000	16,350,500
北洋銀行	109,600	232.000	25,427,200
愛知銀行	2,800	5,470.000	15,316,000
中京銀行	3,400	1,731.000	5,885,400
愛媛銀行	12,700	884.000	11,226,800
京葉銀行	39,000	490.000	19,110,000
栃木銀行	42,300	315.000	13,324,500
東和銀行	16,400	536.000	8,790,400
トモニホールディングス	65,600	321.000	21,057,600
フィデアホールディングス	9,500	1,298.000	12,331,000
池田泉州ホールディングス	104,100	208.000	21,652,800
F P G	29,200	1,127.000	32,908,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,000	1,451.000	8,706,000
S B Iホールディングス	102,800	2,649.000	272,317,200
ジャフコ グループ	29,500	1,855.000	54,722,500
大和証券グループ本社	531,600	600.000	318,960,000

野村ホールディングス	1,271,500	509.000	647,193,500
岡三証券グループ	59,100	342.000	20,212,200
丸三証券	29,000	477.000	13,833,000
東洋証券	30,100	235.000	7,073,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	81,200	374.000	30,368,800
水戸証券	20,800	265.000	5,512,000
いちよし証券	17,000	626.000	10,642,000
松井証券	42,000	799.000	33,558,000
マネックスグループ	71,500	468.000	33,462,000
極東証券	12,400	703.000	8,717,200
岩井コスモホールディングス	9,100	1,261.000	11,475,100
アイザワ証券グループ	11,700	686.000	8,026,200
スパークス・グループ	40,400	299.000	12,079,600
かんぽ生命保険	84,400	2,176.000	183,654,400
S O M P Oホールディングス	118,800	5,983.000	710,780,400
アニコム ホールディングス	29,100	695.000	20,224,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	171,200	4,376.000	749,171,200
第一生命ホールディングス	407,000	2,333.000	949,531,000
東京海上ホールディングス	232,400	7,831.000	1,819,924,400
T & Dホールディングス	186,000	1,516.000	281,976,000
アドバンスクリエイト	7,400	1,011.000	7,481,400
全国保証	20,000	4,500.000	90,000,000
ジェイリース	3,200	2,135.000	6,832,000
日本モーゲージサービス	9,600	990.000	9,504,000
アルヒ	14,400	1,066.000	15,350,400
プレミアグループ	4,400	4,675.000	20,570,000
ネットプロテクションズホールディングス	26,500	628.000	16,642,000
クレディセゾン	49,100	1,708.000	83,862,800
芙蓉総合リース	7,000	8,070.000	56,490,000
みずほリース	10,100	3,320.000	33,532,000
東京センチュリー	12,700	4,770.000	60,579,000
日本証券金融	34,300	838.000	28,743,400
アイフル	143,300	396.000	56,746,800
リコーリース	7,600	3,585.000	27,246,000
イオンフィナンシャルサービス	45,100	1,443.000	65,079,300
アコム	179,700	348.000	62,535,600
ジャックス	8,400	3,790.000	31,836,000
オリエン特コーポレーション	228,000	131.000	29,868,000
オリックス	495,400	2,392.500	1,185,244,500
三菱H Cキャピタル	265,400	646.000	171,448,400
日本取引所グループ	194,900	2,143.500	417,768,150
イー・ギャランティ	13,000	2,321.000	30,173,000
N E Cキャピタルソリューション	3,800	2,136.000	8,116,800
いちご	94,800	304.000	28,819,200
日本駐車場開発	95,900	169.000	16,207,100
スター・マイカ・ホールディングス	5,400	1,558.000	8,413,200
S R Eホールディングス	2,600	2,868.000	7,456,800

ヒューリック	161,500	1,070.000	172,805,000
三栄建築設計	4,300	1,670.000	7,181,000
野村不動産ホールディングス	43,100	3,250.000	140,075,000
三重交通グループホールディングス	20,100	488.000	9,808,800
サムティ	10,100	2,087.000	21,078,700
ディア・ライフ	14,000	628.000	8,792,000
地主	7,000	2,039.000	14,273,000
プレサンスコーポレーション	11,400	1,580.000	18,012,000
JPMC	6,400	1,054.000	6,745,600
フージャースホールディングス	12,700	823.000	10,452,100
オープンハウスグループ	26,500	5,850.000	155,025,000
東急不動産ホールディングス	227,200	729.000	165,628,800
飯田グループホールディングス	68,100	2,218.000	151,045,800
And Doホールディングス	6,000	841.000	5,046,000
シーアールイー	4,000	1,634.000	6,536,000
ケイアイスター不動産	3,900	4,895.000	19,090,500
グッドコムアセット	4,200	1,283.000	5,388,600
ジェイ・エス・ビー	2,100	3,255.000	6,835,500
ロードスターキャピタル	3,500	1,886.000	6,601,000
パーク24	54,500	1,914.000	104,313,000
パラカ	4,400	1,916.000	8,430,400
宮越ホールディングス	3,700	1,030.000	3,811,000
三井不動産	326,200	2,966.000	967,509,200
三菱地所	476,500	1,985.500	946,090,750
平和不動産	13,500	3,870.000	52,245,000
東京建物	66,200	1,963.000	129,950,600
京阪神ビルディング	11,900	1,366.000	16,255,400
住友不動産	150,500	3,719.000	559,709,500
テーオーシー	18,400	808.000	14,867,200
東京楽天地	2,100	4,030.000	8,463,000
スターツコーポレーション	11,100	2,875.000	31,912,500
フジ住宅	13,300	668.000	8,884,400
空港施設	12,600	559.000	7,043,400
明和地所	8,800	638.000	5,614,400
ゴールドクレスト	7,600	1,823.000	13,854,800
エスリード	4,100	1,722.000	7,060,200
日神グループホールディングス	17,400	448.000	7,795,200
日本エスコン	16,200	837.000	13,559,400
タカラレーベン	40,700	364.000	14,814,800
イオンモール	42,500	1,703.000	72,377,500
カチタス	20,600	3,380.000	69,628,000
トーセイ	12,200	1,289.000	15,725,800
サンフロンティア不動産	12,500	1,127.000	14,087,500
FJネクストホールディングス	9,400	1,089.000	10,236,600
グランディハウス	9,100	561.000	5,105,100
日本空港ビルデング	27,200	5,270.000	143,344,000
日本工営	5,400	3,500.000	18,900,000
LIFULL	32,400	179.000	5,799,600

ミクシィ	18,900	2,331.000	44,055,900
ジェイエイシーリクルートメント	6,600	2,032.000	13,411,200
日本M&Aセンターホールディングス	133,200	1,817.000	242,024,400
メンバーズ	2,400	2,690.000	6,456,000
UTグループ	11,800	2,633.000	31,069,400
アイティメディア	4,400	1,598.000	7,031,200
E・Jホールディングス	5,200	1,308.000	6,801,600
夢真ビーネックスグループ	26,500	1,659.000	43,963,500
コシダカホールディングス	23,000	764.000	17,572,000
パソナグループ	8,800	2,065.000	18,172,000
リンクアンドモチベーション	22,700	597.000	13,551,900
エス・エム・エス	27,800	3,480.000	96,744,000
パーソルホールディングス	80,800	2,773.000	224,058,400
リニカル	6,400	849.000	5,433,600
クックパッド	43,500	214.000	9,309,000
学情	4,200	1,062.000	4,460,400
スタジオアリス	4,500	2,334.000	10,503,000
シミックホールディングス	5,500	1,632.000	8,976,000
総合警備保障	29,900	3,645.000	108,985,500
カカクコム	59,800	2,639.000	157,812,200
アイロムグループ	3,600	1,967.000	7,081,200
セントケア・ホールディング	4,000	929.000	3,716,000
ルネサンス	8,000	977.000	7,816,000
ディップ	14,300	3,715.000	53,124,500
デジタルホールディングス	6,600	1,353.000	8,929,800
新日本科学	10,400	1,949.000	20,269,600
ベネフィット・ワン	29,700	2,150.000	63,855,000
エムスリー	143,100	4,669.000	668,133,900
アウトソーシング	43,600	1,209.000	52,712,400
ワールドホールディングス	3,600	2,437.000	8,773,200
ディー・エヌ・エー	31,400	1,962.000	61,606,800
博報堂DYホールディングス	102,400	1,396.000	142,950,400
タカミヤ	14,000	384.000	5,376,000
ジャパンベストレスキューシステム	5,300	763.000	4,043,900
ファンコミュニケーションズ	19,500	391.000	7,624,500
ライク	3,300	2,350.000	7,755,000
エスプール	21,200	1,091.000	23,129,200
WDBホールディングス	3,900	2,592.000	10,108,800
アドウェイズ	10,900	712.000	7,760,800
バリューコマース	5,400	2,794.000	15,087,600
インフォマート	77,000	522.000	40,194,000
JPホールディングス	29,200	261.000	7,621,200
プレステージ・インターナショナル	31,600	676.000	21,361,600
アミューズ	5,100	2,050.000	10,455,000
ドリームインキュベータ	3,100	2,092.000	6,485,200
クイック	5,500	1,664.000	9,152,000
電通グループ	75,900	4,695.000	356,350,500
ぴあ	2,800	3,320.000	9,296,000

イオンファンタジー	3,600	3,065.000	11,034,000
シーティーエス	10,500	780.000	8,190,000
H . U . グループホールディングス	21,900	3,215.000	70,408,500
アルプス技研	7,000	1,951.000	13,657,000
日本空調サービス	11,100	777.000	8,624,700
オリエンタルランド	86,100	21,000.000	1,808,100,000
ダスキン	17,800	3,035.000	54,023,000
明光ネットワークジャパン	14,500	625.000	9,062,500
ファルコホールディングス	4,500	1,939.000	8,725,500
ラウンドワン	23,200	1,548.000	35,913,600
リゾートトラスト	34,800	2,222.000	77,325,600
ピー・エム・エル	10,300	4,010.000	41,303,000
りらいあコミュニケーションズ	11,600	1,119.000	12,980,400
リソー教育	42,800	315.000	13,482,000
早稲田アカデミー	6,200	1,176.000	7,291,200
ユー・エス・エス	90,900	2,603.000	236,612,700
東京個別指導学院	10,200	587.000	5,987,400
サイバーエージェント	173,700	1,348.000	234,147,600
楽天グループ	335,400	672.000	225,388,800
クリーク・アンド・リバー社	4,600	2,407.000	11,072,200
モーニングスター	17,300	507.000	8,771,100
テー・オー・ダブリュー	20,400	316.000	6,446,400
山田コンサルティンググループ	5,300	1,186.000	6,285,800
セントラルスポーツ	4,000	2,594.000	10,376,000
フルキャストホールディングス	7,000	2,379.000	16,653,000
エン・ジャパン	14,700	2,116.000	31,105,200
テクノプロ・ホールディングス	48,600	3,180.000	154,548,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,100	2,226.000	9,126,600
K e e P e r 技研	5,300	3,565.000	18,894,500
G u n o s y	5,700	821.000	4,679,700
イー・ガーディアン	3,300	3,165.000	10,444,500
ジャパンマテリアル	24,900	1,980.000	49,302,000
ベクトル	12,000	1,230.000	14,760,000
チャーム・ケア・コーポレーション	6,800	1,243.000	8,452,400
キャリアリンク	3,300	2,188.000	7,220,400
I B J	6,200	753.000	4,668,600
アサンテ	5,700	1,582.000	9,017,400
バリューHR	7,300	1,458.000	10,643,400
M & A キャピタルパートナーズ	6,800	3,710.000	25,228,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,305.000	6,003,000
シグマクシス・ホールディングス	10,300	1,256.000	12,936,800
ウィルグループ	6,400	1,235.000	7,904,000
メドピア	5,900	2,206.000	13,015,400
リクルートホールディングス	580,000	5,036.000	2,920,880,000
エラン	9,300	1,171.000	10,890,300
日本郵政	886,300	959.300	850,227,590
ベルシステム24ホールディングス	12,300	1,550.000	19,065,000
鎌倉新書	11,200	619.000	6,932,800

エアトリ	5,200	2,566.000	13,343,200
アトラエ	6,100	1,987.000	12,120,700
ストライク	3,600	3,970.000	14,292,000
ソラスト	20,800	838.000	17,430,400
セラク	3,400	1,188.000	4,039,200
インソース	9,100	2,794.000	25,425,400
ベイカレント・コンサルティング	5,700	41,500.000	236,550,000
Orchestra Holdings	1,800	2,723.000	4,901,400
アイモバイル	5,000	1,337.000	6,685,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	25,700	1,652.000	42,456,400
ウェルビー	7,900	800.000	6,320,000
エル・ティー・エス	1,200	3,775.000	4,530,000
ミダックホールディングス	3,800	3,025.000	11,495,000
日総工産	7,900	604.000	4,771,600
キュービーネットホールディングス	5,200	1,383.000	7,191,600
RPAホールディングス	15,000	320.000	4,800,000
マネジメントソリューションズ	4,200	3,215.000	13,503,000
フロンティア・マネジメント	3,200	1,512.000	4,838,400
カーブスホールディングス	23,100	750.000	17,325,000
フォーラムエンジニアリング	4,700	966.000	4,540,200
FAST FITNESS JAPAN	2,100	1,505.000	3,160,500
ダイレクトマーケティングミックス	8,700	2,097.000	18,243,900
LITALICO	6,800	2,534.000	17,231,200
リログループ	44,800	2,229.000	99,859,200
東祥	8,400	1,361.000	11,432,400
ビーウィズ	3,200	1,491.000	4,771,200
TREホールディングス	15,700	1,576.000	24,743,200
人・夢・技術グループ	3,700	2,680.000	9,916,000
エイチ・アイ・エス	16,700	2,089.000	34,886,300
ラックランド	3,300	2,997.000	9,890,100
共立メンテナンス	14,600	5,340.000	77,964,000
イチネンホールディングス	9,100	1,268.000	11,538,800
建設技術研究所	3,900	2,709.000	10,565,100
スペース	4,000	907.000	3,628,000
燦ホールディングス	4,000	1,875.000	7,500,000
東京テアトル	2,400	1,227.000	2,944,800
ナガワ	2,200	8,500.000	18,700,000
東京都競馬	6,400	4,440.000	28,416,000
カナモト	13,700	2,062.000	28,249,400
西尾レントオール	6,700	2,918.000	19,550,600
トランス・コスモス	10,300	3,875.000	39,912,500
乃村工藝社	34,800	894.000	31,111,200
日本管財	8,500	2,726.000	23,171,000
トーカイ	6,900	1,815.000	12,523,500
セコム	79,900	8,908.000	711,749,200
セントラル警備保障	4,300	2,579.000	11,089,700
丹青社	16,600	807.000	13,396,200

メイテック	29,300	2,514.000	73,660,200	
応用地質	7,300	1,764.000	12,877,200	
船井総研ホールディングス	15,300	2,362.000	36,138,600	
学究社	5,300	1,591.000	8,432,300	
ベネッセホールディングス	27,900	2,393.000	66,764,700	
イオンディライト	9,400	2,902.000	27,278,800	
ダイセキ	14,800	4,035.000	59,718,000	
ステップ	3,600	1,764.000	6,350,400	
合 計	85,618,800		212,510,660,160	

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2022年8月1日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	6,158,270,363
金銭信託	60,340,546
コール・ローン	1,789,546,673
株式	386,740,363,681
投資証券	10,402,230,699
派生商品評価勘定	626,382,964
未収入金	1,015,189
未収配当金	346,318,433
差入委託証拠金	3,087,340,382
流動資産合計	409,211,808,930
資産合計	409,211,808,930
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	34,878,849
未払解約金	17,309,998
その他未払費用	3,257
流動負債合計	52,192,104
負債合計	52,192,104
純資産の部	
元本等	
元本	67,966,658,267
剰余金	
剰余金又は欠損金()	341,192,958,559
元本等合計	409,159,616,826

純資産合計	409,159,616,826
負債純資産合計	409,211,808,930

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	67,966,658,267口

2. 1 単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.0200円 (1万口当たりの純資産額60,200円)
-----------------	---

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT SEP22	8,846,878,362	-	9,366,988,419	520,110,057
	SPI 200 FUTURES SEP22	431,854,211	-	445,673,620	13,819,409
	FTSE 100 IDX FUT SEP22	535,703,732	-	549,024,697	13,320,965
	EURO STOXX 50 SEP22	1,614,327,315	-	1,693,456,948	79,129,633
	小計	11,428,763,620	-	12,055,143,684	626,380,064
	合 計	11,428,763,620	-	12,055,143,684	626,380,064

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,037,870,274	-	1,019,304,195	18,566,079
	カナダ・ドル	287,920,668	-	281,139,701	6,780,967
	オーストラリア・ドル	35,050,230	-	34,337,091	713,139
	香港・ドル	16,036,405	-	15,743,993	292,412
	シンガポール・ドル	6,843,234	-	6,733,924	109,310
	ニュージーランド・ドル	846,269	-	835,777	10,492
	イギリス・ポンド	70,792,925	-	69,560,376	1,232,549
	イスラエル・シケル	3,561,701	-	3,518,550	43,151
	スイス・フラン	243,191,800	-	238,733,661	4,458,139
	デンマーク・クローネ	12,237,885	-	12,031,800	206,085
	ノルウェー・クローネ	4,306,294	-	4,252,897	53,397

	スウェーデン・ク ローナ	14,329,892	-	14,104,336	225,556
	ユーロ	114,849,344	-	112,664,200	2,185,144
	小計	1,847,836,921	-	1,812,960,501	34,876,420
売建					
	オーストラリア・ド ル	3,712,180	-	3,711,820	360
	スイス・フラン	2,792,106	-	2,792,220	114
	デンマーク・クロー ネ	364,636	-	364,600	36
	ユーロ	4,072,389	-	4,072,200	189
	小計	10,941,311	-	10,940,840	471
	合 計	1,858,778,232	-	1,823,901,341	34,875,949

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年8月1日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	59,078,726,266円
同期中における追加設定元本額	19,640,038,396円
同期中における一部解約元本額	10,752,106,395円
2022年8月1日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	34,733,896,260円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	280,118,679円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,100,741,638円

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	786,163,769円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	20,389,639円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	1,063,978円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	5,420,667円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	16,928,513円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	49,509,209円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	53,701,606円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	103,207,893円
外国株式指数ファンド	903,071,746円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	15,968,602,038円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	115,858,724円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	141,996,746円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	91,745,918円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	17,990,075円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	131,023,896円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	115,719,630円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	412,273,145円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	220,776,733円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	254,384,276円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	49,639,667円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	1,187,575,922円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	10,784,275円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	44,052,551円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	38,766,257円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,260,994円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	255,467,483円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	202,446,669円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	817,753,491円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	31,968,659円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	498,667,229円
バランスファンドV A(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	3,659,992円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	24,198,253円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	607,701,671円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	762,002,699円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	3,277,005,179円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	10,511,330円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	57,429,615円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	443,908,807円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	38,301,233円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	93,355,655円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	440,464,244円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	323,699,139円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	748,575,290円
S M A M・バランスV A株40T < 適格機関投資家限定 >	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	206,647,291円
S M A M・グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	67,106,772円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	8,298,484円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	7,431,222円

SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,930,927円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	19,715,913円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	56,182,302円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	118,304,403円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	55,242,525円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	386,432,895円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	89,630,415円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,344,017,106円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	14,641,393円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	10,217,683円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	13,200,417円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	70,677,212円
合計	67,966,658,267円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APA CORP	19,759	37.170	734,442.03	
	BAKER HUGHES CO	54,309	25.690	1,395,198.21	
	CHENIERE ENERGY INC	13,763	149.580	2,058,669.54	
	CHEVRON CORP	117,467	163.780	19,238,745.26	
	CONOCOPHILLIPS	78,964	97.430	7,693,462.52	
	COTERRA ENERGY INC	46,347	30.590	1,417,754.73	
	DEVON ENERGY CORP	36,196	62.850	2,274,918.60	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	9,236	128.020	1,182,392.72	
	EOG RESOURCES INC	35,969	111.220	4,000,472.18	
	EQT CORP	19,298	44.030	849,690.94	
	EXXON MOBIL CORP	255,020	96.930	24,719,088.60	
	HALLIBURTON CO	54,852	29.300	1,607,163.60	
	HESS CORP	15,806	112.470	1,777,700.82	
	KINDER MORGAN INC	127,394	17.990	2,291,818.06	
	MARATHON OIL CORP	42,380	24.800	1,051,024.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	33,051	91.660	3,029,454.66	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,874	65.750	3,607,965.50	
	ONEOK INC	28,226	59.740	1,686,221.24	
	PHILLIPS 66	29,008	89.000	2,581,712.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,868	236.950	3,286,022.60	
SCHLUMBERGER LTD	84,809	37.030	3,140,477.27		
TARGA RESOURCES CORP	12,350	69.110	853,508.50		
VALERO ENERGY CORP	24,663	110.770	2,731,920.51		

WILLIAMS COS INC	75,529	34.090	2,574,783.61	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,678	248.230	3,395,289.94	
ALBEMARLE CORP	7,433	244.310	1,815,956.23	
ALCOA CORP	11,849	50.890	602,995.61	
AMCOR PLC	97,610	12.950	1,264,049.50	
AVERY DENNISON CORP	5,454	190.460	1,038,768.84	
BALL CORP	19,410	73.420	1,425,082.20	
CELANESE CORP	6,643	117.510	780,618.93	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	95.490	1,146,070.98	
CLEVELAND-CLIFFS INC	33,403	17.710	591,567.13	
CORTEVA INC	44,440	57.550	2,557,522.00	
CROWN HOLDINGS INC	6,863	101.680	697,829.84	
DOW INC	44,543	53.210	2,370,133.03	
DUPONT DE NEMOURS INC	30,490	61.230	1,866,902.70	
EASTMAN CHEMICAL CO	7,027	95.930	674,100.11	
ECOLAB INC	15,225	165.170	2,514,713.25	
FMC CORP	6,676	111.100	741,703.60	
FREEMPORT-MCMORAN INC	87,567	31.550	2,762,738.85	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	42.770	1,003,897.44	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	15,629	124.050	1,938,777.45	
LINDE PLC	30,757	302.000	9,288,614.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,818	89.120	1,320,580.16	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,559	352.080	1,253,052.72	
MOSAIC CO/THE	21,306	52.660	1,121,973.96	
NEWMONT CORP	46,428	45.280	2,102,259.84	
NUCOR CORP	15,778	135.800	2,142,652.40	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,550	140.610	780,385.50	
PPG INDUSTRIES INC	13,502	129.290	1,745,673.58	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	90.400	695,718.40	
SEALED AIR CORP	7,895	61.120	482,542.40	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,187	241.940	3,674,342.78	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	77.880	990,088.44	
VULCAN MATERIALS CO	7,555	165.330	1,249,068.15	
WESTLAKE CORP	2,189	97.340	213,077.26	
WESTROCK CO	16,766	42.360	710,207.76	
3M CO	33,648	143.240	4,819,739.52	
AERCAP HOLDINGS NV	8,780	44.860	393,870.80	
ALLEGION PLC	4,764	105.700	503,554.80	
AMETEK INC	13,117	123.500	1,619,949.50	
BOEING CO/THE	33,801	159.310	5,384,837.31	
CARRIER GLOBAL CORP	50,896	40.530	2,062,814.88	
CATERPILLAR INC	32,639	198.250	6,470,681.75	
CUMMINS INC	8,207	221.310	1,816,291.17	
DEERE & CO	17,769	343.180	6,097,965.42	

DOVER CORP	8,225	133.680	1,099,518.00	
EATON CORP PLC	23,512	148.390	3,488,945.68	
EMERSON ELECTRIC CO	36,697	90.070	3,305,298.79	
FASTENAL CO	32,763	51.360	1,682,707.68	
FORTIVE CORP	21,981	64.450	1,416,675.45	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,166	69.680	499,326.88	
GENERAC HOLDINGS INC	3,973	268.300	1,065,955.90	
GENERAL DYNAMICS CORP	13,933	226.670	3,158,193.11	
GENERAL ELECTRIC CO	67,280	73.910	4,972,664.80	
HEICO CORP	3,085	157.710	486,535.35	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	127.680	583,497.60	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	41,155	192.460	7,920,691.30	
HOWMET AEROSPACE INC	23,889	37.130	886,998.57	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,107	216.840	456,881.88	
IDEX CORP	4,788	208.750	999,495.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	18,441	207.760	3,831,302.16	
INGERSOLL-RAND INC	25,011	49.800	1,245,547.80	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	14,100	52.790	744,339.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	42,895	53.910	2,312,469.45	
KORNIT DIGITAL LTD	3,043	27.210	82,800.03	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,965	239.970	2,871,241.05	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	239.530	503,971.12	
LOCKHEED MARTIN CORP	14,923	413.810	6,175,286.63	
MASCO CORP	14,885	55.380	824,331.30	
NORDSON CORP	2,884	230.990	666,175.16	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,085	478.900	4,350,806.50	
OTIS WORLDWIDE CORP	25,348	78.170	1,981,453.16	
OWENS CORNING	5,205	92.740	482,711.70	
PACCAR INC	21,897	91.520	2,004,013.44	
PARKER HANNIFIN CORP	8,047	289.090	2,326,307.23	
PENTAIR PLC	8,220	48.890	401,875.80	
PLUG POWER INC	28,584	21.340	609,982.56	
QUANTA SERVICES INC	8,891	138.730	1,233,448.43	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	90,482	93.210	8,433,827.22	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,031	255.280	1,794,873.68	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	44.470	337,972.00	
SMITH (A.O.) CORP	7,157	63.270	452,823.39	
SNAP-ON INC	3,106	224.050	695,899.30	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	97.330	888,525.57	
TEXTRON INC	11,803	65.640	774,748.92	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	14,363	146.990	2,111,217.37	
TRANSDIGM GROUP INC	3,010	622.340	1,873,243.40	
UNITED RENTALS INC	4,113	322.670	1,327,141.71	
WABTEC CORP	11,284	93.470	1,054,715.48	

WW GRAINGER INC	2,797	543.530	1,520,253.41	
XYLEM INC	10,225	92.030	941,006.75	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	95.980	770,623.42	
CINTAS CORP	5,707	425.490	2,428,271.43	
CLARIVATE PLC	19,939	14.490	288,916.11	
COPART INC	12,238	128.100	1,567,687.80	
COSTAR GROUP INC	25,116	72.590	1,823,170.44	
EQUIFAX INC	6,841	208.910	1,429,153.31	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,422	137.300	1,156,340.60	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,863	107.000	948,341.00	
REPUBLIC SERVICES INC	12,824	138.660	1,778,175.84	
ROBERT HALF INTL INC	5,555	79.140	439,622.70	
ROLLINS INC	11,493	38.570	443,285.01	
TRANSUNION	11,233	79.230	889,990.59	
VERISK ANALYTICS INC	9,674	190.250	1,840,478.50	
WASTE CONNECTIONS INC	16,122	133.370	2,150,191.14	
WASTE MANAGEMENT INC	25,212	164.560	4,148,886.72	
AMERCO	650	537.080	349,102.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,925	110.700	766,597.50	
CSX CORP	129,345	32.330	4,181,723.85	
DELTA AIR LINES INC	8,299	31.800	263,908.20	
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	106.250	1,108,825.00	
FEDEX CORP	15,488	233.090	3,610,097.92	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	96,661	2.950	285,149.95	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,530	183.270	1,013,483.10	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	54.950	436,303.00	
LYFT INC-A	13,145	13.860	182,189.70	
NORFOLK SOUTHERN CORP	14,151	251.170	3,554,306.67	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,539	303.510	1,681,141.89	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	38.120	269,737.12	
UBER TECHNOLOGIES INC	89,549	23.450	2,099,924.05	
UNION PACIFIC CORP	38,617	227.300	8,777,644.10	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	44,423	194.890	8,657,598.47	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	6,249	49.820	311,325.18	
APTIV PLC	15,307	104.890	1,605,551.23	
BORGWARNER INC	12,075	38.460	464,404.50	
FORD MOTOR CO	237,633	14.690	3,490,828.77	
GENERAL MOTORS CO	80,889	36.260	2,933,035.14	
LEAR CORP	3,736	151.140	564,659.04	
LUCID GROUP INC	21,730	18.250	396,572.50	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	9,269	34.300	317,926.70	
TESLA INC	52,832	891.450	47,097,086.40	
DR HORTON INC	20,992	78.030	1,638,005.76	
GARMIN LTD	8,444	97.620	824,303.28	

HASBRO INC	7,491	78.720	589,691.52	
LENNAR CORP-A	14,494	85.000	1,231,990.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,214	310.510	2,240,019.14	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	128.480	367,838.24	
NEWELL BRANDS INC	26,997	20.210	545,609.37	
NIKE INC -CL B	76,925	114.920	8,840,221.00	
NVR INC	173	4,393.100	760,006.30	
PELTON INTERACTIVE INC-A	15,071	9.490	143,023.79	
PULTEGROUP INC	13,075	43.620	570,331.50	
VF CORP	20,583	44.680	919,648.44	
WHIRLPOOL CORP	3,212	172.870	555,258.44	
AIRBNB INC-CLASS A	19,751	110.980	2,191,965.98	
ARAMARK	13,242	33.400	442,282.80	
BOOKING HOLDINGS INC	2,502	1,935.690	4,843,096.38	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	13,336	45.690	609,321.84	
CARNIVAL CORP	48,156	9.060	436,293.36	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,745	1,564.220	2,729,563.90	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	124.490	946,870.94	
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	392.110	831,665.31	
EXPEDIA GROUP INC	8,061	106.050	854,869.05	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	17,462	128.070	2,236,358.34	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	37.690	664,625.46	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	16,807	158.820	2,669,287.74	
MCDONALD'S CORP	44,952	263.370	11,839,008.24	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	32.730	726,540.54	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	38.710	460,261.90	
STARBUCKS CORP	70,068	84.780	5,940,365.04	
VAIL RESORTS INC	2,038	237.130	483,270.94	
WYNN RESORTS LTD	7,730	63.480	490,700.40	
YUM! BRANDS INC	18,046	122.540	2,211,356.84	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	193.620	663,342.12	
AMAZON.COM INC	550,361	134.950	74,271,216.95	
AUTOZONE INC	1,276	2,137.390	2,727,309.64	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	35.540	547,316.00	
BEST BUY CO INC	12,132	76.990	934,042.68	
BURLINGTON STORES INC	3,391	141.130	478,571.83	
CARMAX INC	10,366	99.540	1,031,831.64	
CARVANA CO	4,496	29.150	131,058.40	
CHEWY INC - CLASS A	3,969	38.810	154,036.89	
DOLLAR GENERAL CORP	13,704	248.430	3,404,484.72	
DOLLAR TREE INC	13,992	165.360	2,313,717.12	
DOORDASH INC - A	11,627	69.750	810,983.25	
EBAY INC	35,551	48.630	1,728,845.13	
ETSY INC	7,168	103.720	743,464.96	

GENUINE PARTS CO	8,711	152.870	1,331,650.57	
HOME DEPOT INC	62,948	300.940	18,943,571.12	
LKQ CORP	15,922	54.840	873,162.48	
LOWE'S COS INC	40,655	191.530	7,786,652.15	
MERCADOLIBRE INC	2,577	813.710	2,096,930.67	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,967	703.590	2,791,141.53	
POOL CORP	2,578	357.700	922,150.60	
ROSS STORES INC	22,258	81.260	1,808,685.08	
TARGET CORP	29,311	163.380	4,788,831.18	
TJX COMPANIES INC	70,347	61.160	4,302,422.52	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,072	191.480	1,354,146.56	
ULTA BEAUTY INC	3,287	388.910	1,278,347.17	
WAYFAIR INC- CLASS A	3,756	53.910	202,485.96	
COSTCO WHOLESALE CORP	26,771	541.300	14,491,142.30	
KROGER CO	41,915	46.440	1,946,532.60	
SYSCO CORP	31,126	84.900	2,642,597.40	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	46,212	39.620	1,830,919.44	
WALMART INC	92,199	132.050	12,174,877.95	
ALTRIA GROUP INC	106,761	43.860	4,682,537.46	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	33,026	82.770	2,733,562.02	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,950	74.220	1,406,469.00	
BUNGE LTD	8,301	92.330	766,431.33	
CAMPBELL SOUP CO	10,638	49.350	524,985.30	
COCA-COLA CO/THE	248,510	64.170	15,946,886.70	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,260	54.120	717,631.20	
CONAGRA BRANDS INC	30,896	34.210	1,056,952.16	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,715	246.310	2,392,901.65	
GENERAL MILLS INC	37,327	74.790	2,791,686.33	
HERSHEY CO/THE	8,265	227.960	1,884,089.40	
HORMEL FOODS CORP	19,475	49.340	960,896.50	
JM SMUCKER CO/THE	5,768	132.320	763,221.76	
KELLOGG CO	15,843	73.920	1,171,114.56	
KEURIG DR PEPPER INC	46,903	38.740	1,817,022.22	
KRAFT HEINZ CO/THE	44,124	36.830	1,625,086.92	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	15,162	87.350	1,324,400.70	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,629	59.750	575,332.75	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	83,311	64.040	5,335,236.44	
MONSTER BEVERAGE CORP	23,823	99.620	2,373,247.26	
PEPSICO INC	83,515	174.960	14,611,784.40	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	93,002	97.150	9,035,144.30	
TYSON FOODS INC-CL A	16,951	88.010	1,491,857.51	
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,330	87.970	1,260,610.10	
CLOROX COMPANY	7,384	141.840	1,047,346.56	
COLGATE-PALMOLIVE CO	46,908	78.740	3,693,535.92	

ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	13,654	273.100	3,728,907.40	
KIMBERLY-CLARK CORP	19,797	131.790	2,609,046.63	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	144,426	138.910	20,062,215.66	
ABBOTT LABORATORIES	106,604	108.840	11,602,779.36	
ABIOMED INC	2,731	293.010	800,210.31	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,154	280.970	1,167,149.38	
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,688	145.930	1,267,839.84	
BAXTER INTERNATIONAL INC	30,726	58.660	1,802,387.16	
BECTON DICKINSON AND CO	17,445	244.310	4,261,987.95	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	84,237	41.050	3,457,928.85	
CARDINAL HEALTH INC	15,114	59.560	900,189.84	
CENTENE CORP	34,234	92.970	3,182,734.98	
CIGNA CORP	19,571	275.360	5,389,070.56	
COOPER COS INC/THE	2,771	327.000	906,117.00	
CVS HEALTH CORP	79,647	95.680	7,620,624.96	
DAVITA INC	4,138	84.160	348,254.08	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	36.160	429,002.24	
DEXCOM INC	23,299	82.080	1,912,381.92	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	36,775	100.540	3,697,358.50	
ELEVANCE HEALTH INC	14,654	477.100	6,991,423.40	
HCA HEALTHCARE INC	14,575	212.420	3,096,021.50	
HENRY SCHEIN INC	7,559	78.830	595,875.97	
HOLOGIC INC	13,592	71.380	970,196.96	
HUMANA INC	7,599	482.000	3,662,718.00	
IDEXX LABORATORIES INC	4,980	399.180	1,987,916.40	
INSULET CORP	4,263	247.800	1,056,371.40	
INTUITIVE SURGICAL INC	21,555	230.170	4,961,314.35	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	5,327	262.190	1,396,686.13	
MASIMO CORP	2,941	144.580	425,209.78	
MCKESSON CORP	8,861	341.580	3,026,740.38	
MEDTRONIC PLC	81,515	92.520	7,541,767.80	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,428	327.720	1,123,424.16	
NOVOCURE LTD	4,517	67.990	307,110.83	
QUEST DIAGNOSTICS INC	6,814	136.570	930,587.98	
RESMED INC	8,775	240.520	2,110,563.00	
STERIS PLC	6,271	225.650	1,415,051.15	
STRYKER CORP	20,390	214.750	4,378,752.50	
TELADOC HEALTH INC	7,496	36.850	276,227.60	
TELEFLEX INC	3,067	240.460	737,490.82	
UNITEDHEALTH GROUP INC	56,622	542.340	30,708,375.48	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	112.470	472,711.41	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,342	223.580	1,865,104.36	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,628	110.390	1,283,614.92	
ABBVIE INC	106,698	143.510	15,312,229.98	

AGILENT TECHNOLOGIES INC	18,024	134.100	2,417,018.40	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,810	142.040	967,292.40	
AMGEN INC	33,426	247.470	8,271,932.22	
AVANTOR INC	37,382	29.020	1,084,825.64	
BIOGEN INC	8,733	215.060	1,878,118.98	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,557	86.050	994,479.85	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	563.260	687,177.20	
BIO-TECHNE CORP	2,551	385.280	982,849.28	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	131,933	73.780	9,734,016.74	
CATALENT INC	10,797	113.100	1,221,140.70	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,577	250.540	645,641.58	
DANAHER CORP	41,119	291.470	11,984,954.93	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	20.260	421,630.86	
ELI LILLY & CO	48,836	329.690	16,100,740.84	
EXACT SCIENCES CORP	9,771	45.100	440,672.10	
GILEAD SCIENCES INC	75,244	59.750	4,495,829.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	13,945	82.970	1,157,016.65	
ILLUMINA INC	9,281	216.680	2,011,007.08	
INCYTE CORP	11,842	77.680	919,886.56	
IQVIA HOLDINGS INC	11,280	240.270	2,710,245.60	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	156.060	638,129.34	
JOHNSON & JOHNSON	158,257	174.520	27,619,011.64	
MERCK & CO. INC.	152,589	89.340	13,632,301.26	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,369	1,349.730	1,847,780.37	
MODERNA INC	20,549	164.090	3,371,885.41	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,359	94.130	598,572.67	
PERKINELMER INC	6,979	153.170	1,068,973.43	
PFIZER INC	339,093	50.510	17,127,587.43	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,546	581.690	3,807,742.74	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	20,785	43.490	903,939.65	
SEAGEN INC	7,790	179.980	1,402,044.20	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	66,266	9.380	621,575.08	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	23,475	598.410	14,047,674.75	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	15,277	280.410	4,283,823.57	
VIATRIS INC	63,072	9.690	611,167.68	
WATERS CORP	3,425	364.030	1,246,802.75	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,241	343.560	1,457,037.96	
ZOETIS INC	28,322	182.550	5,170,181.10	
BANK OF AMERICA CORP	438,418	33.810	14,822,912.58	
CITIGROUP INC	120,748	51.900	6,266,821.20	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	30,366	37.970	1,152,997.02	
FIFTH THIRD BANCORP	42,445	34.120	1,448,223.40	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	670	756.680	506,975.60	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10,970	162.710	1,784,928.70	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	88,161	13.290	1,171,659.69	
JPMORGAN CHASE & CO	177,940	115.360	20,527,158.40	
KEYCORP	51,128	18.300	935,642.40	
M & T BANK CORP	11,046	177.450	1,960,112.70	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	24,673	165.940	4,094,237.62	
REGIONS FINANCIAL CORP	53,059	21.180	1,123,789.62	
SIGNATURE BANK	3,256	185.570	604,215.92	
SVB FINANCIAL GROUP	3,727	403.550	1,504,030.85	
TRUIST FINANCIAL CORP	78,394	50.470	3,956,545.18	
US BANCORP	86,383	47.200	4,077,277.60	
WEBSTER FINANCIAL CORP	9,600	46.450	445,920.00	
WELLS FARGO & CO	230,933	43.870	10,131,030.71	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	33.070	665,996.73	
AMERICAN EXPRESS CO	39,319	154.020	6,055,912.38	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,380	269.920	1,722,089.60	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	24,207	57.100	1,382,219.70	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	44,547	43.460	1,936,012.62	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	77,785	300.600	23,382,171.00	
BLACKROCK INC	9,264	669.180	6,199,283.52	
BLACKSTONE INC	42,926	102.070	4,381,456.82	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	25,579	109.830	2,809,341.57	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	38.910	392,757.54	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	123.380	698,454.18	
CME GROUP INC	21,983	199.480	4,385,168.84	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,252	62.960	456,585.92	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	101.000	1,658,925.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	28.430	648,772.60	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,377	429.680	1,021,349.36	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	27.450	392,480.10	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,375	41.600	223,600.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,555	333.390	6,852,831.45	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	33,145	101.990	3,380,458.55	
INVESCO LTD	18,328	17.740	325,138.72	
KKR & CO INC	33,210	55.460	1,841,826.60	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,992	209.920	1,047,920.64	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	270.780	517,731.36	
MOODY'S CORP	9,844	310.250	3,054,101.00	
MORGAN STANLEY	81,229	84.300	6,847,604.70	
MSCI INC	5,079	481.340	2,444,725.86	
NASDAQ INC	6,509	180.900	1,177,478.10	
NORTHERN TRUST CORP	11,023	99.780	1,099,874.94	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,520	98.470	1,134,374.40	
S&P GLOBAL INC	21,396	376.930	8,064,794.28	
SCHWAB (CHARLES) CORP	88,319	69.050	6,098,426.95	

SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	55.360	303,428.16	
STATE STREET CORP	20,939	71.040	1,487,506.56	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	33.480	1,075,109.76	
T ROWE PRICE GROUP INC	13,663	123.470	1,686,970.61	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	70.520	368,114.40	
UPSTART HOLDINGS INC	5,556	24.330	135,177.48	
AFLAC INC	37,779	57.300	2,164,736.70	
ALLEGHANY CORP	912	837.480	763,781.76	
ALLSTATE CORP	16,419	116.970	1,920,530.43	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	133.680	650,486.88	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	50,566	51.770	2,617,801.82	
AON PLC-CLASS A	13,151	291.040	3,827,467.04	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,476	44.400	909,134.40	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	13,030	178.990	2,332,239.70	
ASSURANT INC	3,114	175.780	547,378.92	
BROWN & BROWN INC	14,273	65.100	929,172.30	
CHUBB LTD	26,038	188.640	4,911,808.32	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,520	97.340	829,336.80	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	203.360	261,927.68	
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	261.350	539,687.75	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,937	39.960	556,922.52	
GLOBE LIFE INC	6,373	100.730	641,952.29	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	64.470	1,181,799.57	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	51.340	445,477.18	
LOEWS CORP	12,727	58.250	741,347.75	
MARKEL CORP	837	1,297.140	1,085,706.18	
MARSH & MCLENNAN COS	30,733	163.960	5,038,982.68	
METLIFE INC	41,426	63.250	2,620,194.50	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	66.940	945,460.56	
PROGRESSIVE CORP	34,466	115.060	3,965,657.96	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	22,933	99.990	2,293,070.67	
TRAVELERS COS INC/THE	15,031	158.700	2,385,419.70	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	206.940	1,411,951.62	
WR BERKLEY CORP	11,142	62.530	696,709.26	
CBRE GROUP INC - A	20,793	85.620	1,780,296.66	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	5.190	410,529.00	
ZILLOW GROUP INC - C	10,672	34.880	372,239.36	
ACCENTURE PLC-CL A	38,236	306.260	11,710,157.36	
ADOBE INC	28,528	410.120	11,699,903.36	
AFFIRM HOLDINGS INC	9,077	26.840	243,626.68	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,300	96.220	991,066.00	
ANSYS INC	4,983	278.990	1,390,207.17	
APPROVIN CORP-CLASS A	8,926	35.540	317,230.04	
AUTODESK INC	13,358	216.320	2,889,602.56	

AUTOMATIC DATA PROCESSING	25,601	241.120	6,172,913.12	
AVALARA INC	4,319	87.420	377,566.98	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	8,808	39.600	348,796.80	
BILL.COM HOLDINGS INC	6,004	135.080	811,020.32	
BLACK KNIGHT INC	10,656	65.680	699,886.08	
BLOCK INC	31,499	76.060	2,395,813.94	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,244	160.550	1,163,024.20	
CADENCE DESIGN SYS INC	16,147	186.080	3,004,633.76	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	54.770	382,239.83	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,776	124.600	844,289.60	
CITRIX SYSTEMS INC	8,351	101.410	846,874.91	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	14,179	50.320	713,487.28	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	32,759	67.960	2,226,301.64	
COUPA SOFTWARE INC	3,490	65.420	228,315.80	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	11,620	183.600	2,133,432.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,859	130.130	372,041.67	
DATADOG INC - CLASS A	14,023	102.010	1,430,486.23	
DOCUSIGN INC	12,031	63.980	769,743.38	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	22.740	377,120.16	
DYNATRACE INC	9,587	37.630	360,758.81	
EPAM SYSTEMS INC	3,095	349.250	1,080,928.75	
FAIR ISAAC CORP	1,494	462.030	690,272.82	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	35,812	102.160	3,658,553.92	
FISERV INC	36,154	105.680	3,820,754.72	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	220.090	962,013.39	
FORTINET INC	39,440	59.650	2,352,596.00	
GARTNER INC	4,568	265.480	1,212,712.64	
GLOBAL PAYMENTS INC	16,551	122.320	2,024,518.32	
GODADDY INC - CLASS A	8,905	74.180	660,572.90	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	77.720	367,693.32	
HUBSPOT INC	2,561	308.000	788,788.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	54,380	130.790	7,112,360.20	
INTUIT INC	16,358	456.170	7,462,028.86	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	207.770	813,419.55	
MASTERCARD INC - A	52,625	353.790	18,618,198.75	
MICROSOFT CORP	427,708	280.740	120,074,743.92	
MONGODB INC	4,150	312.470	1,296,750.50	
NORTONLIFELOCK INC	31,347	24.530	768,941.91	
OKTA INC	8,044	98.450	791,931.80	
ORACLE CORP	97,339	77.840	7,576,867.76	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	98,735	10.350	1,021,907.25	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,786	499.100	2,887,792.60	
PAYCHEX INC	19,074	128.280	2,446,812.72	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,007	330.490	993,783.43	

PAYPAL HOLDINGS INC	67,541	86.530	5,844,322.73
PTC INC	7,295	123.380	900,057.10
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	49.490	197,564.08
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,148	436.670	2,684,647.16
SALESFORCE INC	59,606	184.020	10,968,696.12
SERVICENOW INC	12,197	446.660	5,447,912.02
SNOWFLAKE INC-CLASS A	13,250	149.910	1,986,307.50
SPLUNK INC	9,792	103.910	1,017,486.72
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,487	59.170	857,195.79
SYNOPSYS INC	8,914	367.500	3,275,895.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	24,100	45.000	1,084,500.00
TWILIO INC - A	10,905	84.800	924,744.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,406	399.000	959,994.00
UNITY SOFTWARE INC	10,899	37.390	407,513.61
VERISIGN INC	6,425	189.160	1,215,353.00
VISA INC-CLASS A SHARES	99,922	212.110	21,194,455.42
VMWARE INC-CLASS A	12,016	116.200	1,396,259.20
WESTERN UNION CO	21,840	17.020	371,716.80
WIX.COM LTD	3,194	59.330	189,500.02
WORKDAY INC-CLASS A	12,069	155.100	1,871,901.90
ZENDESK INC	6,067	75.420	457,573.14
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	13,927	103.860	1,446,458.22
ZSCALER INC	4,551	155.060	705,678.06
AMPHENOL CORP-CL A	34,872	77.130	2,689,677.36
APPLE INC	979,864	162.510	159,237,698.64
ARISTA NETWORKS INC	14,847	116.630	1,731,605.61
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	128.170	529,342.10
CDW CORP/DE	8,621	181.530	1,564,970.13
CISCO SYSTEMS INC	251,245	45.370	11,398,985.65
COGNEX CORP	8,698	50.980	443,424.04
CORNING INC	45,688	36.760	1,679,490.88
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	45.060	846,992.82
F5 INC	3,921	167.360	656,218.56
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	71,283	14.240	1,015,069.92
HP INC	62,253	33.390	2,078,627.67
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	28.030	489,403.80
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	10,527	162.600	1,711,690.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,793	238.590	2,336,511.87
NETAPP INC	13,273	71.330	946,763.09
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	79.980	943,764.00
TE CONNECTIVITY LTD	19,805	133.730	2,648,522.65
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,844	391.400	1,113,141.60
TRIMBLE INC	15,566	69.430	1,080,747.38
WESTERN DIGITAL CORP	18,492	49.100	907,957.20

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,257	357.690	1,164,996.33	
ADVANCED MICRO DEVICES	99,128	94.470	9,364,622.16	
ANALOG DEVICES INC	31,941	171.960	5,492,574.36	
APPLIED MATERIALS INC	53,908	105.980	5,713,169.84	
BROADCOM INC	24,750	535.480	13,253,130.00	
ENPHASE ENERGY INC	8,302	284.180	2,359,262.36	
ENTEGRIS INC	7,892	109.900	867,330.80	
INTEL CORP	246,511	36.310	8,950,814.41	
KLA CORP	8,854	383.540	3,395,863.16	
LAM RESEARCH CORP	8,195	500.510	4,101,679.45	
MARVELL TECHNOLOGY INC	49,498	55.680	2,756,048.64	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	32,867	68.860	2,263,221.62	
MICRON TECHNOLOGY INC	68,578	61.860	4,242,235.08	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,437	464.720	1,132,522.64	
NVIDIA CORP	150,539	181.630	27,342,398.57	
NXP SEMICONDUCTORS NV	15,423	183.880	2,835,981.24	
ON SEMICONDUCTOR	24,630	66.780	1,644,791.40	
QORVO INC	6,042	104.070	628,790.94	
QUALCOMM INC	68,219	145.060	9,895,848.14	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,677	108.880	1,162,511.76	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	3,319	360.130	1,195,271.47	
TERADYNE INC	10,642	100.890	1,073,671.38	
TEXAS INSTRUMENTS INC	55,943	178.890	10,007,643.27	
AT&T INC	428,631	18.780	8,049,690.18	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	22.890	482,498.31	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	21.760	183,480.32	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	10.890	541,864.62	
T-MOBILE US INC	38,105	143.060	5,451,301.30	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	253,565	46.190	11,712,167.35	
AES CORP	41,893	22.220	930,862.46	
ALLIANT ENERGY CORP	13,644	60.930	831,328.92	
AMEREN CORPORATION	14,760	93.120	1,374,451.20	
AMERICAN ELECTRIC POWER	29,356	98.560	2,893,327.36	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,241	155.440	1,591,861.04	
ATMOS ENERGY CORP	8,726	121.390	1,059,249.14	
CENTERPOINT ENERGY INC	37,091	31.690	1,175,413.79	
CMS ENERGY CORP	16,996	68.730	1,168,135.08	
CONSOLIDATED EDISON INC	22,160	99.270	2,199,823.20	
CONSTELLATION ENERGY	18,329	66.100	1,211,546.90	
DOMINION ENERGY INC	49,705	81.980	4,074,815.90	
DTE ENERGY COMPANY	12,057	130.300	1,571,027.10	
DUKE ENERGY CORP	46,960	109.930	5,162,312.80	
EDISON INTERNATIONAL	21,701	67.770	1,470,676.77	
ENTERGY CORP	12,677	115.130	1,459,503.01	

ESSENTIAL UTILITIES INC	13,909	51.940	722,433.46	
EVERGY INC	13,333	68.260	910,110.58	
EVERSOURCE ENERGY	19,764	88.220	1,743,580.08	
EXELON CORP	59,385	46.490	2,760,808.65	
FIRSTENERGY CORP	31,966	41.100	1,313,802.60	
NEXTERA ENERGY INC	118,840	84.490	10,040,791.60	
NISOURCE INC	25,829	30.400	785,201.60	
NRG ENERGY INC	13,547	37.750	511,399.25	
P G & E CORP	91,894	10.860	997,968.84	
PPL CORP	47,199	29.080	1,372,546.92	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	29,861	65.670	1,960,971.87	
SEMPRA ENERGY	18,378	165.800	3,047,072.40	
SOUTHERN CO/THE	64,788	76.890	4,981,549.32	
UGI CORP	10,588	43.160	456,978.08	
VISTRA CORP	25,777	25.850	666,335.45	
WEC ENERGY GROUP INC	19,774	103.810	2,052,738.94	
XCEL ENERGY INC	31,157	73.180	2,280,069.26	
ACTIVISION BLIZZARD INC	45,498	79.950	3,637,565.10	
ALPHABET INC-CL A	361,721	116.320	42,075,386.72	
ALPHABET INC-CL C	341,697	116.640	39,855,538.08	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	27,658	14.560	402,700.48	
CABLE ONE INC	388	1,376.680	534,151.84	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,256	432.100	3,135,317.60	
COMCAST CORP-CLASS A	273,525	37.520	10,262,658.00	
DISH NETWORK CORP-A	12,937	17.370	224,715.69	
ELECTRONIC ARTS INC	16,640	131.230	2,183,667.20	
FOX CORP - CLASS A	16,962	33.110	561,611.82	
FOX CORP - CLASS B	8,773	30.900	271,085.70	
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	68.500	272,219.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	29.870	777,426.49	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	108.930	892,790.28	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	67.770	697,217.76	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	4,141	39.850	165,018.85	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	7,648	39.820	304,543.36	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,080	93.990	1,041,409.20	
MATCH GROUP INC	17,799	73.310	1,304,844.69	
META PLATFORMS INC-CLASS A	139,063	159.100	22,124,923.30	
NETFLIX INC	26,692	224.900	6,003,030.80	
NEWS CORP - CLASS A	23,102	17.140	395,968.28	
OMNICOM GROUP	12,545	69.840	876,142.80	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,381	23.650	765,810.65	
PINTEREST INC- CLASS A	38,300	19.480	746,084.00	
ROBLOX CORP -CLASS A	22,745	42.930	976,442.85	
ROKU INC	6,012	65.520	393,906.24	

	SEA LTD-ADR	22,722	76.320	1,734,143.04	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	6.680	377,754.00	
	SNAP INC - A	64,099	9.880	633,298.12	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,123	132.730	1,210,895.79	
	TWITTER INC	45,558	41.610	1,895,668.38	
	WALT DISNEY CO/THE	109,253	106.100	11,591,743.30	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	136,145	15.000	2,042,175.00	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	15,382	37.890	582,823.98	
	アメリカ・ドル小計	20,398,367		2,152,492,125.17 (286,087,728,356)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	17.960	806,817.08	
	CAMECO CORP	26,627	32.980	878,158.46	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	72,331	70.710	5,114,525.01	
	CENOVUS ENERGY INC	85,669	24.400	2,090,323.60	
	ENBRIDGE INC	123,311	57.510	7,091,615.61	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	61.370	797,748.63	
	KEYERA CORP	11,374	33.190	377,503.06	
	PARKLAND CORP	7,666	35.930	275,439.38	
	PEMBINA PIPELINE CORP	32,172	48.890	1,572,889.08	
	SUNCOR ENERGY INC	82,343	43.460	3,578,626.78	
	TC ENERGY CORP	57,397	68.270	3,918,493.19	
	TOURMALINE OIL CORP	20,401	80.230	1,636,772.23	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	27,243	55.060	1,499,999.58	
	BARRICK GOLD CORP	102,105	20.180	2,060,478.90	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	64.330	559,992.65	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	23.400	741,124.80	
	FRANCO-NEVADA CORP	11,502	163.970	1,885,982.94	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	7.960	260,276.08	
	KINROSS GOLD CORP	63,501	4.390	278,769.39	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	7.220	335,340.12	
	NUTRIEN LTD	34,081	109.620	3,735,959.22	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	26.060	306,543.78	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	29,836	37.650	1,123,325.40	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	119.890	532,071.82	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,168	43.940	1,149,821.92	
	CAE INC	17,963	33.880	608,586.44	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	107.850	650,011.95	
	WSP GLOBAL INC	7,668	154.500	1,184,706.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	35.440	351,316.72		
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,667	92.300	523,064.10		
THOMSON REUTERS CORP	9,710	143.790	1,396,200.90		
AIR CANADA	12,083	17.390	210,123.37		
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,438	162.230	5,911,336.74		
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	54,847	100.970	5,537,901.59		

TFI INTERNATIONAL INC	5,097	127.900	651,906.30
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,331	81.770	1,335,385.87
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	97.400	300,186.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	37.530	424,164.06
RESTAURANT BRANDS INTERN	19,270	68.650	1,322,885.50
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	164.510	493,694.51
DOLLARAMA INC	17,025	77.610	1,321,310.25
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	52,906	57.210	3,026,752.26
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	38.860	355,491.28
LOBLAW COMPANIES LTD	9,797	116.570	1,142,036.29
METRO INC/CN	13,109	70.910	929,559.19
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	152.840	761,754.56
SAPUTO INC	13,425	31.630	424,632.75
BAUSCH HEALTH COS INC	16,447	5.900	97,037.30
BANK OF MONTREAL	38,213	127.660	4,878,271.58
BANK OF NOVA SCOTIA	74,287	78.010	5,795,128.87
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	54,574	64.780	3,535,303.72
NATIONAL BANK OF CANADA	19,626	89.850	1,763,396.10
ROYAL BANK OF CANADA	85,871	124.860	10,721,853.06
TORONTO-DOMINION BANK	110,697	83.180	9,207,776.46
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	83,168	63.540	5,284,494.72
IGM FINANCIAL INC	4,949	37.180	184,003.82
ONEX CORPORATION	4,217	68.440	288,611.48
TMX GROUP LTD	3,142	131.390	412,827.38
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	689.800	960,891.40
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	31.120	441,904.00
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	70.460	341,801.46
INTACT FINANCIAL CORP	10,095	190.600	1,924,107.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	121,416	23.440	2,845,991.04
POWER CORP OF CANADA	31,768	34.800	1,105,526.40
SUN LIFE FINANCIAL INC	37,083	59.460	2,204,955.18
FIRSTSERVICE CORP	2,516	171.310	431,015.96
BLACKBERRY LTD	25,993	7.870	204,564.91
CGI INC	13,476	109.800	1,479,664.80
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,183	2,178.360	2,576,999.88
LIGHTSPEED COMMERCE INC	6,363	27.480	174,855.24
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	44.760	225,679.92
OPEN TEXT CORP	15,337	52.380	803,352.06
SHOPIFY INC - CLASS A	70,950	44.610	3,165,079.50
BCE INC	5,509	64.700	356,432.30
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	22,595	58.870	1,330,167.65
TELUS CORP	15,222	29.480	448,744.56
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	17.910	790,798.14
ALTAGAS LTD	17,347	28.530	494,909.91

	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	50.100	317,433.60	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	41.450	304,408.80	
	EMERA INC	14,279	60.710	866,878.09	
	FORTIS INC	30,171	60.490	1,825,043.79	
	HYDRO ONE LTD	18,821	35.750	672,850.75	
	NORTHLAND POWER INC	15,741	41.980	660,807.18	
	QUEBECOR INC -CL B	9,953	28.450	283,162.85	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	31,175	34.640	1,079,902.00	
	カナダ・ドル小計	2,441,668		141,958,239.00 (14,728,167,296)	
オーストラ リア・ドル	AMPOL LTD	14,428	33.500	483,338.00	
	SANTOS LTD	182,883	7.300	1,335,045.90	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,722	25.690	326,828.18	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	114,178	31.980	3,651,412.44	
	BHP GROUP LTD	304,731	38.680	11,786,995.08	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	16.590	617,380.26	
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	2.640	222,868.80	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	105,200	18.340	1,929,368.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	26,108	35.200	919,001.60	
	MINERAL RESOURCES LTD	11,662	53.740	626,715.88	
	NEWCREST MINING LTD	54,082	19.300	1,043,782.60	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	7.840	516,216.96	
	ORICA LTD	17,981	16.780	301,721.18	
	RIO TINTO LTD	21,049	97.830	2,059,223.67	
	SOUTH32 LTD	276,348	3.810	1,052,885.88	
	REECE LTD	13,059	15.230	198,888.57	
	BRAMBLES LTD	86,089	11.450	985,719.05	
	AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	4.020	523,609.02	
	QANTAS AIRWAYS LTD	45,831	4.560	208,989.36	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	37,719	35.300	1,331,480.70	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,794	72.440	274,837.36	
	IDP EDUCATION LTD	10,940	28.540	312,227.60	
	LOTTERY CORP LTD/THE	139,785	4.540	634,623.90	
	WESFARMERS LTD	69,354	46.630	3,233,977.02	
	COLES GROUP LTD	79,056	18.750	1,482,300.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	89,318	7.920	707,398.56	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	74,760	37.520	2,804,995.20	
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	12.250	446,684.00		
COCHLEAR LTD	4,095	214.230	877,271.85		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,781	70.200	756,826.20		
SONIC HEALTHCARE LTD	24,258	34.270	831,321.66		
CSL LTD	29,329	289.840	8,500,717.36		
AUST AND NZ BANKING GROUP	166,819	22.900	3,820,155.10		
AUSTRALIA & NEW ZEALAND -RTS	11,121	3.980	44,261.58		

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	103,692	100.770	10,449,042.84	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	198,227	30.600	6,065,746.20	
	WESTPAC BANKING CORP	204,187	21.510	4,392,062.37	
	ASX LTD	11,180	88.260	986,746.80	
	MACQUARIE GROUP LTD	22,604	181.130	4,094,262.52	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	4.470	776,684.85	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.410	438,948.84	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	80,863	11.530	932,350.39	
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	11.190	715,410.27	
	COMPUTERSHARE LTD	28,738	24.980	717,875.24	
	WISETECH GLOBAL LTD	10,621	50.100	532,112.10	
	XERO LTD	8,683	92.990	807,432.17	
	TELSTRA CORP LTD	273,343	3.890	1,063,304.27	
	ORIGIN ENERGY LTD	90,928	5.940	540,112.32	
	REA GROUP LTD	2,833	125.060	354,294.98	
	SEEK LTD	21,957	22.940	503,693.58	
	オーストラリア・ドル小計	3,815,941		88,219,148.26 (8,187,619,150)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	173,424	52.050	9,026,719.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	83,000	87.050	7,225,150.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	15.460	1,453,240.00	
	MTR CORP	84,500	41.500	3,506,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	26.650	1,865,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	118,000	46.700	5,510,600.00	
	SANDS CHINA LTD	142,400	18.400	2,620,160.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	117,000	15.520	1,815,840.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	21.750	1,948,800.00	
	WH GROUP LTD	561,000	5.940	3,332,340.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	28.350	5,315,625.00	
	HANG SENG BANK LTD	48,200	126.500	6,097,300.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	70,800	359.000	25,417,200.00	
	AIA GROUP LTD	733,800	79.000	57,970,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	126,924	55.450	7,037,935.80	
	ESR GROUP LTD	102,000	20.350	2,075,700.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	14.280	1,399,440.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	27.300	2,276,383.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	26.200	2,222,624.60	
	SINO LAND CO	248,200	11.660	2,894,012.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	89,000	93.750	8,343,750.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	44.650	1,205,550.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	53,000	18.680	990,040.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	34.900	3,175,900.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	49.200	2,017,200.00	
	CLP HOLDINGS LTD	94,100	66.500	6,257,650.00	

	HONG KONG & CHINA GAS	606,389	8.280	5,020,900.92	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	91,500	51.350	4,698,525.00	
	香港・ドル小計	4,409,554		182,721,035.72 (3,093,467,135)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	70,500	6.880	485,040.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	4.020	436,572.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	5.450	424,914.70	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.805	263,637.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	4.020	414,864.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	109,800	31.470	3,455,406.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	211,400	11.670	2,467,038.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	68,900	27.550	1,898,195.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,800	9.900	423,720.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	176,200	3.920	690,704.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.750	199,950.00	
	UOL GROUP LTD	30,900	7.460	230,514.00	
	VENTURE CORP LTD	15,700	17.580	276,006.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	480,715	2.610	1,254,666.15	
	シンガポール・ドル小計	1,849,981		12,921,227.35 (1,243,151,283)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	70,711	7.460	527,504.06	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,250	21.200	662,500.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	90,895	5.100	463,564.50	
	MERCURY NZ LTD	62,522	6.070	379,508.54	
	MERIDIAN ENERGY LTD	66,454	4.970	330,276.38	
	ニュージーランド・ドル小計	321,832		2,363,353.48 (197,552,717)	
イギリス・ポンド	BP PLC	1,168,521	4.000	4,674,084.00	
	SHELL PLC	458,661	21.790	9,994,223.19	
	ANGLO AMERICAN PLC	74,677	29.500	2,202,971.50	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	11.585	225,200.81	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,838	74.820	586,439.16	
	GLENCORE PLC	594,109	4.618	2,743,595.36	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	21.370	215,281.38	
	MONDI PLC	33,905	15.495	525,357.97	
	RIO TINTO PLC	68,899	49.245	3,392,931.25	
	ASHTREAD GROUP PLC	26,131	45.910	1,199,674.21	
	BAE SYSTEMS PLC	187,435	7.700	1,443,249.50	
	BUNZL PLC	22,658	30.710	695,827.18	
	DCC PLC	5,954	53.500	318,539.00	
	FERGUSON PLC	13,361	102.900	1,374,846.90	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	305,227	1.605	489,889.33	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	494,144	0.892	440,776.44	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	15.425	375,891.82	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,459	119.350	532,181.65		

EXPERIAN PLC	54,749	28.630	1,567,463.87	
INTERTEK GROUP PLC	8,184	43.760	358,131.84	
RELX PLC	113,165	24.260	2,745,382.90	
RENTOKIL INITIAL PLC	112,603	5.412	609,407.43	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	5.010	324,477.66	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	42.380	281,276.06	
BURBERRY GROUP PLC	26,233	17.960	471,144.68	
PERSIMMON PLC	16,916	18.840	318,697.44	
TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.271	286,722.34	
COMPASS GROUP PLC	105,469	19.145	2,019,204.00	
ENTAIN PLC	29,792	12.025	358,248.80	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,820	48.470	572,915.40	
WHITBREAD PLC	11,282	25.980	293,106.36	
JD SPORTS FASHION PLC	144,300	1.295	186,868.50	
KINGFISHER PLC	109,678	2.586	283,627.30	
NEXT PLC	9,030	68.060	614,581.80	
OCADO GROUP PLC	27,379	8.394	229,819.32	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.210	250,790.80	
TESCO PLC	439,670	2.626	1,154,573.42	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,258	16.720	405,593.76	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	132,652	32.205	4,272,057.66	
COCA-COLA HBC AG-DI	8,704	20.120	175,124.48	
DIAGEO PLC	140,860	38.820	5,468,185.20	
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	17.990	899,553.97	
HALEON PLC	293,573	2.918	856,646.01	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	42,262	66.460	2,808,732.52	
UNILEVER PLC	155,490	40.035	6,225,042.15	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	57,278	10.475	599,987.05	
ASTRAZENECA PLC	93,609	108.440	10,150,959.96	
GSK PLC	234,858	17.276	4,057,406.80	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	17.300	252,407.00	
BARCLAYS PLC	994,963	1.571	1,563,086.87	
HSBC HOLDINGS PLC	1,228,760	5.137	6,312,140.12	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,324,726	0.452	1,954,776.15	
NATWEST GROUP PLC	316,287	2.486	786,289.48	
STANDARD CHARTERED PLC	146,561	5.642	826,897.16	
3I GROUP PLC	60,807	12.695	771,944.86	
ABRDN PLC	123,263	1.657	204,246.79	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	8.482	166,009.70	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,328	79.980	1,625,833.44	
M&G PLC	133,064	2.133	283,825.51	
SCHRODERS PLC	6,213	29.700	184,526.10	
ST JAMES' S PLACE PLC	33,823	12.275	415,177.32	

	ADMIRAL GROUP PLC	11,535	19.180	221,241.30	
	AVIVA PLC	174,060	3.960	689,277.60	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	386,391	2.610	1,008,480.51	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	36,851	6.438	237,246.73	
	PRUDENTIAL PLC	161,840	10.060	1,628,110.40	
	AVEVA GROUP PLC	6,037	23.570	142,292.09	
	SAGE GROUP PLC/THE	55,987	7.044	394,372.42	
	HALMA PLC	24,375	22.990	560,381.25	
	BT GROUP PLC	403,957	1.618	653,602.42	
	VODAFONE GROUP PLC	1,639,544	1.208	1,980,569.15	
	NATIONAL GRID PLC	224,329	11.315	2,538,282.63	
	SEVERN TRENT PLC	14,904	29.500	439,668.00	
	SSE PLC	61,355	17.680	1,084,756.40	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	42,035	10.900	458,181.50	
	AUTO TRADER GROUP PLC	51,319	6.296	323,104.42	
	INFORMA PLC	102,755	5.942	610,570.21	
	PEARSON PLC	39,623	7.566	299,787.61	
	WPP PLC	63,987	8.838	565,517.10	
	イギリス・ポンド小計	17,311,930		109,459,331.77 (17,708,330,694)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	41,773	30.680	1,281,595.64	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	778.900	1,081,892.10	
	BANK HAPOLIM BM	66,403	31.630	2,100,326.89	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	92,639	33.000	3,057,087.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	85,339	19.290	1,646,189.31	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	124.100	1,147,800.90	
	AZRIELI GROUP LTD	2,140	269.900	577,586.00	
	NICE LTD	3,251	722.300	2,348,197.30	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	7,438	162.200	1,206,443.60	
	イスラエル・シュケル小計	309,621		14,447,118.74 (564,831,778)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	17.790	179,696.79	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	752.000	267,712.00	
	GIVAUDAN-REG	568	3,315.000	1,882,920.00	
	HOLCIM LTD	35,246	44.430	1,565,979.78	
	SIKA AG-REG	8,429	233.900	1,971,543.10	
	ABB LTD-REG	96,406	28.770	2,773,600.62	
	GEBERIT AG-REG	2,322	498.900	1,158,445.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	179.600	317,173.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	185.000	394,420.00	
	VAT GROUP AG	1,436	274.800	394,612.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,118	33.430	304,814.74	
	SGS SA-REG	374	2,315.000	865,810.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,570	255.200	911,064.00	

	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	31,233	113.950	3,559,000.35	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	252.600	433,461.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,516	47.360	119,157.76	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	2,104.000	454,464.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	59	10,500.000	619,500.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	109,600.000	657,600.00	
	NESTLE SA-REG	169,634	116.440	19,752,182.96	
	ALCON INC	31,165	74.440	2,319,922.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,269	341.000	1,114,729.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	7,044	127.800	900,223.20	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,610	63.850	102,798.50	
	LONZA GROUP AG-REG	4,526	576.200	2,607,881.20	
	NOVARTIS AG-REG	132,472	81.710	10,824,287.12	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,740	387.200	673,728.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	42,408	315.400	13,375,483.20	
	VIFOR PHARMA AG	2,638	170.300	449,251.40	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	168,196	5.540	931,805.84	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,550	49.000	614,950.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,372	1,033.000	1,417,276.00	
	UBS GROUP AG-REG	205,002	15.485	3,174,455.97	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	151.300	374,467.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,834	502.800	922,135.20	
	SWISS RE AG	19,228	71.300	1,370,956.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,220	414.900	3,825,378.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	86.550	338,064.30	
	TEMENOS AG - REG	3,743	75.000	280,725.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,426	53.120	553,829.12	
	SWISSCOM AG-REG	1,709	513.800	878,084.20	
	スイス・フラン小計	1,043,737		85,633,591.65 (11,955,305,730)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,211	475.800	3,430,993.80	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	464.300	5,345,021.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	1,797.000	921,861.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	58,797	189.540	11,144,383.38	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	19,410.000	3,998,460.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	19,790.000	6,154,690.00	
	DSV A/S	11,417	1,220.000	13,928,740.00	
	PANDORA A/S	5,888	537.600	3,165,388.80	
	CARLSBERG AS-B	5,585	940.000	5,249,900.00	
	COLOPLAST-B	6,399	849.400	5,435,310.60	
	DEMANT A/S	8,178	276.800	2,263,670.40	
	GN STORE NORD A/S	6,484	252.500	1,637,210.00	
	GENMAB A/S	3,688	2,595.000	9,570,360.00	
NOVO NORDISK A/S-B	101,776	854.000	86,916,704.00		

	DANSKE BANK A/S	39,103	101.600	3,972,864.80	
	TRYG A/S	24,975	165.750	4,139,606.25	
	ORSTED A/S	12,090	845.600	10,223,304.00	
	デンマーク・クローネ小計	304,133		177,498,468.63 (3,235,797,083)	
ノル ウェー・ク ローネ	AKER BP ASA	19,201	333.900	6,411,213.90	
	EQUINOR ASA	57,415	369.000	21,186,135.00	
	NORSK HYDRO ASA	87,753	65.060	5,709,210.18	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	411.000	3,701,055.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,176	355.000	1,482,480.00	
	MOWI ASA	23,318	222.200	5,181,259.60	
	ORKLA ASA	46,955	83.260	3,909,473.30	
	SALMAR ASA	4,188	689.500	2,887,626.00	
	DNB BANK ASA	52,746	189.600	10,000,641.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	201.400	2,298,376.80	
	TELENOR ASA	40,694	117.000	4,761,198.00	
	ADEVINTA ASA	15,540	72.700	1,129,758.00	
	ノルウェー・クローネ小計	372,403		68,658,427.38 (941,993,625)	
スウェーデ ン・クロー ナ	BOLIDEN AB	15,297	336.950	5,154,324.15	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	415.900	2,921,281.60	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	34,370	147.850	5,081,604.50	
	ALFA LAVAL AB	18,697	302.000	5,646,494.00	
	ASSA ABLOY AB-B	62,454	238.900	14,920,260.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	169,730	118.020	20,031,534.60	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	89,280	104.780	9,354,758.40	
	EPIROC AB-A	44,746	178.700	7,996,110.20	
	EPIROC AB-B	19,836	160.650	3,186,653.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	80.720	1,500,826.96	
	INDUTRADE AB	17,913	237.500	4,254,337.50	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	251.700	2,069,729.10	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	196.500	2,976,778.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	89,271	101.800	9,087,787.80	
	SANDVIK AB	61,070	186.150	11,368,180.50	
	SKANSKA AB-B SHS	17,183	172.400	2,962,349.20	
	SKF AB-B SHARES	20,607	170.200	3,507,311.40	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	188.700	2,506,502.10	
	VOLVO AB-B SHS	90,883	181.560	16,500,717.48	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	102.450	1,651,801.35	
VOLVO CAR AB-B	38,628	75.540	2,917,959.12		
ELECTROLUX AB-B	11,555	145.880	1,685,643.40		
EVOLUTION AB	11,254	978.400	11,010,913.60		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,148	129.320	5,191,939.36		
SWEDISH MATCH AB	103,037	106.200	10,942,529.40		

	ESSITY AKTIEBOLAG-B	36,076	258.000	9,307,608.00	
	GETINGE AB-B SHS	13,151	228.300	3,002,373.30	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	222.700	3,009,345.10	
	NORDEA BANK ABP	193,686	99.910	19,351,168.26	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	90,586	109.650	9,932,754.90	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	97,603	91.120	8,893,585.36	
	SWEDBANK AB - A SHARES	57,603	140.200	8,075,940.60	
	EQT AB	15,443	273.600	4,225,204.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	263.900	1,902,982.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	261.000	2,777,562.00	
	INVESTOR AB-A SHS	27,415	208.100	5,705,061.50	
	INVESTOR AB-B SHS	111,744	188.800	21,097,267.20	
	KINNEVIK AB - B	12,465	181.950	2,268,006.75	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	480.300	2,920,704.30	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	31,938	64.590	2,062,875.42	
	SAGAX AB-B	9,651	260.600	2,515,050.60	
	SINCH AB	27,690	25.430	704,156.70	
	ERICSSON LM-B SHS	183,318	76.870	14,091,654.66	
	HEXAGON AB-B SHS	117,010	118.950	13,918,339.50	
	TELE2 AB-B SHS	38,424	115.950	4,455,262.80	
	TELIA CO AB	143,404	37.470	5,373,347.88	
	EMBRACER GROUP AB	30,012	77.000	2,310,924.00	
	スウェーデン・クローナ小計	2,309,020		312,329,504.75 (4,079,023,332)	
ユーロ	ENI SPA	154,027	11.716	1,804,580.33	
	GALP ENERGIA SGPS SA	25,920	10.280	266,457.60	
	NESTE OYJ	26,563	50.080	1,330,275.04	
	OMV AG	8,389	41.420	347,472.38	
	REPSOL SA	79,358	12.125	962,215.75	
	TENARIS SA	25,963	13.605	353,226.61	
	TOTALENERGIES SE	149,954	49.760	7,461,711.04	
	AIR LIQUIDE SA	32,024	134.120	4,295,058.88	
	AKZO NOBEL N.V.	9,886	65.780	650,301.08	
	ARCELORMITTAL	37,054	23.915	886,146.41	
	ARKEMA	3,250	92.300	299,975.00	
	BASF SE	54,599	43.415	2,370,415.58	
	COVESTRO AG	11,797	33.230	392,014.31	
	CRH PLC	45,964	37.425	1,720,202.70	
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,952	20.780	227,582.56	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	49.500	429,511.50	
	KONINKLIJKE DSM NV	10,433	155.900	1,626,504.70	
	OCI NV	6,000	33.940	203,640.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,189	35.280	606,427.92	
	SOLVAY SA	4,802	85.500	410,571.00	

STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	15.060	455,324.04	
SYMRISE AG	7,711	113.600	875,969.60	
UMICORE	13,160	35.360	465,337.60	
UPM-KYMMENE OYJ	32,818	30.890	1,013,748.02	
VOESTALPINE AG	7,382	21.900	161,665.80	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,189	23.410	308,754.49	
AIRBUS SE	36,169	104.880	3,793,404.72	
ALSTOM	17,665	23.150	408,944.75	
BOUYGUES SA	11,049	29.500	325,945.50	
BRENTAG SE	9,920	68.360	678,131.20	
CNH INDUSTRIAL NV	68,766	12.475	857,855.85	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	29,471	45.325	1,335,773.07	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,358	26.590	780,629.22	
DASSAULT AVIATION SA	1,720	139.500	239,940.00	
EIFFAGE	4,989	91.460	456,293.94	
FERROVIAL SA	31,613	26.080	824,467.04	
GEA GROUP AG	8,178	36.370	297,433.86	
IMCD NV	3,214	155.800	500,741.20	
KINGSPAN GROUP PLC	7,943	63.020	500,567.86	
KION GROUP AG	3,179	44.350	140,988.65	
KNORR-BREMSE AG	3,881	58.060	225,330.86	
KONE OYJ-B	20,623	44.500	917,723.50	
LEGRAND SA	15,079	79.880	1,204,510.52	
MTU AERO ENGINES AG	2,957	188.100	556,211.70	
PRYSMIAN SPA	17,186	30.950	531,906.70	
RATIONAL AG	350	678.500	237,475.00	
RHEINMETALL AG	2,899	178.850	518,486.15	
SAFRAN SA	20,172	106.980	2,158,000.56	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	33,134	134.540	4,457,848.36	
SIEMENS AG-REG	45,906	108.540	4,982,637.24	
SIEMENS ENERGY AG	31,878	16.185	515,945.43	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,482	17.930	205,872.26	
THALES SA	7,074	121.350	858,429.90	
VINCI SA	32,001	93.380	2,988,253.38	
WARTSILA OYJ ABP	26,753	8.548	228,684.64	
BUREAU VERITAS SA	17,817	26.930	479,811.81	
RANDSTAD NV	6,241	49.250	307,369.25	
TELEPERFORMANCE	3,420	326.300	1,115,946.00	
WOLTERS KLUWER	16,360	106.000	1,734,160.00	
ADP	1,346	134.600	181,171.60	
AENA SME SA	4,377	123.000	538,371.00	
ATLANTIA SPA	26,501	22.570	598,127.57	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,148	5.994	198,689.11	
DEUTSCHE POST AG-REG	56,987	38.900	2,216,794.30	

GETLINK SE	30,428	19.530	594,258.84
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	20,347	79.480	1,617,179.56
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,564	73.900	189,479.60
CONTINENTAL AG	5,578	69.220	386,109.16
FERRARI NV	7,986	206.200	1,646,713.20
MERCEDES-BENZ GROUP AG	49,688	57.220	2,843,147.36
MICHELIN (CGDE)	38,468	27.165	1,044,983.22
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,089	70.400	710,265.60
RENAULT SA	8,830	28.745	253,818.35
STELLANTIS NV	130,810	13.922	1,821,136.82
VALEO	14,444	20.890	301,735.16
VOLKSWAGEN AG	1,960	192.200	376,712.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	10,563	137.300	1,450,299.90
ADIDAS AG	10,395	167.800	1,744,281.00
ESSILORLUXOTTICA	17,807	152.450	2,714,677.15
HERMES INTERNATIONAL	1,973	1,334.000	2,631,982.00
KERING	4,486	556.900	2,498,253.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	16,793	675.000	11,335,275.00
MONCLER SPA	12,209	48.670	594,212.03
PUMA SE	6,459	65.620	423,839.58
SEB SA	1,127	82.050	92,470.35
ACCOR SA	10,451	25.280	264,201.28
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	9,582	97.740	936,544.68
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	34.850	201,607.25
SODEXO SA	4,760	79.240	377,182.40
DELIVERY HERO SE	8,530	46.910	400,142.30
D'IETEREN GROUP	1,449	159.500	231,115.50
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	64,479	23.690	1,527,507.51
JUST EAT TAKEAWAY	9,307	17.800	165,664.60
PROSUS NV	51,027	63.610	3,245,827.47
ZALANDO SE	12,367	27.350	338,237.45
CARREFOUR SA	35,990	16.640	598,873.60
HELLOFRESH SE	9,790	26.850	262,861.50
JERONIMO MARTINS	20,863	22.620	471,921.06
KESKO OYJ-B SHS	13,402	24.120	323,256.24
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	64,661	26.885	1,738,410.98
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	51,027	52.270	2,667,181.29
DANONE	37,302	53.810	2,007,220.62
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	10.820	303,187.22
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	77.000	474,936.00
HEINEKEN NV	14,659	96.100	1,408,729.90
JDE PEET'S NV	6,660	28.340	188,744.40
KERRY GROUP PLC-A	9,894	103.250	1,021,555.50
PERNOD RICARD SA	12,775	191.500	2,446,412.50

REMY COINTREAU	1,273	192.600	245,179.80
BEIERSDORF AG	6,813	100.650	685,728.45
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	61.450	367,102.30
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	10,398	62.280	647,587.44
L'OREAL	14,699	368.100	5,410,701.90
AMPLIFON SPA	7,567	32.210	243,733.07
BIOMERIEUX	2,791	105.600	294,729.60
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	142.100	307,078.10
DIASORIN SPA	1,313	135.600	178,042.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	13,613	36.160	492,246.08
FRESENIUS SE & CO KGAA	23,254	24.950	580,187.30
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,727	20.155	1,062,712.68
SARTORIUS AG-VORZUG	1,682	435.500	732,511.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,426	50.020	821,628.52
ARGENX SE	2,904	357.200	1,037,308.80
BAYER AG-REG	57,979	57.000	3,304,803.00
EUROFINS SCIENTIFIC	7,010	76.020	532,900.20
GRIFOLS SA	15,169	14.220	215,703.18
IPSEN	1,498	98.800	148,002.40
MERCK KGAA	7,777	185.700	1,444,188.90
ORION OYJ-CLASS B	6,261	46.610	291,825.21
QIAGEN N.V.	15,665	48.860	765,391.90
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	43.230	348,779.64
SANOFI	69,067	97.210	6,714,003.07
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	389.600	605,828.00
UCB SA	7,782	76.300	593,766.60
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	9.980	287,294.26
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	420,232	4.417	1,856,164.74
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	187,906	0.010	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	1,046,474	2.440	2,553,396.56
BNP PARIBAS	68,484	46.000	3,150,264.00
CAIXABANK SA	245,314	2.929	718,524.70
COMMERZBANK AG	60,640	6.678	404,953.92
CREDIT AGRICOLE SA	73,102	8.979	656,382.85
ERSTE GROUP BANK AG	19,383	24.700	478,760.10
FINECOBANK SPA	32,034	12.090	387,291.06
ING GROEP NV	229,641	9.491	2,179,522.73
INTESA SANPAOLO	1,011,886	1.728	1,748,539.00
KBC GROUP NV	13,092	51.120	669,263.04
MEDIOBANCA SPA	31,303	8.360	261,693.08
SOCIETE GENERALE SA	48,558	21.835	1,060,263.93
UNICREDIT SPA	127,961	9.580	1,225,866.38
AMUNDI SA	3,955	52.900	209,219.50
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	113,478	8.526	967,513.42

DEUTSCHE BOERSE AG	11,916	170.500	2,031,678.00	
EURAZEO SE	1,792	69.650	124,812.80	
EURONEXT NV	5,502	79.480	437,298.96	
EXOR NV	6,204	68.360	424,105.44	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	86.280	510,259.92	
SOFINA	804	228.400	183,633.60	
WENDEL	1,082	89.650	97,001.30	
AEGON NV	127,748	4.284	547,272.43	
AGEAS	11,247	42.550	478,559.85	
ALLIANZ SE-REG	24,953	177.320	4,424,665.96	
ASSICURAZIONI GENERALI	64,729	14.585	944,072.46	
AXA SA	113,848	22.450	2,555,887.60	
HANNOVER RUECK SE	3,598	138.300	497,603.40	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,295	221.100	1,834,024.50	
NN GROUP NV	16,917	45.680	772,768.56	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	8.170	283,662.40	
SAMPO OYJ-A SHS	31,972	42.140	1,347,300.08	
AROUNDTOWN SA	73,508	3.125	229,712.50	
LEG IMMOBILIEN SE	4,538	88.640	402,248.32	
VONOVIA SE	41,790	32.470	1,356,921.30	
ADYEN NV	1,288	1,745.000	2,247,560.00	
AMADEUS IT GROUP SA	26,736	56.680	1,515,396.48	
BECHTLE AG	4,305	45.010	193,768.05	
CAPGEMINI SE	9,621	185.350	1,783,252.35	
DASSAULT SYSTEMES SE	40,049	41.660	1,668,441.34	
EDENRED	14,650	50.100	733,965.00	
NEMETSCHKE SE	3,011	65.000	195,715.00	
NEXI SPA	30,853	8.854	273,172.46	
SAP SE	62,732	90.680	5,688,537.76	
WORLDLINE SA	12,774	43.000	549,282.00	
NOKIA OYJ	321,416	5.099	1,638,900.18	
ASM INTERNATIONAL NV	2,455	298.100	731,835.50	
ASML HOLDING NV	24,565	555.400	13,643,401.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	79,641	26.550	2,114,468.55	
STMICROELECTRONICS NV	43,538	36.930	1,607,858.34	
CELLNEX TELECOM SA	32,830	43.590	1,431,059.70	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	195,063	18.506	3,609,835.87	
ELISA OYJ	8,681	54.040	469,121.24	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	10.240	161,832.96	
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	3.221	559,175.26	
ORANGE	116,269	9.997	1,162,341.19	
PROXIMUS	10,895	13.545	147,572.77	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.216	150,412.68	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	79,654	2.596	206,781.78	

TELEFONICA SA	335,910	4.357	1,463,559.87	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	25.670	135,255.23	
ACCIONA SA	1,810	200.600	363,086.00	
E.ON SE	126,998	8.770	1,113,772.46	
EDF	32,658	11.860	387,323.88	
EDP RENOVAVEIS SA	14,791	25.300	374,212.30	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	170,355	4.939	841,383.34	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	148.300	313,061.30	
ENAGAS SA	14,471	19.280	279,000.88	
ENDESA SA	14,104	17.910	252,602.64	
ENEL SPA	476,432	4.909	2,338,804.68	
ENGIE	102,009	12.060	1,230,228.54	
FORTUM OYJ	24,312	10.915	265,365.48	
IBERDROLA SA	356,214	10.430	3,715,312.02	
IBERDROLA SA-RTS	330,738	0.268	88,637.78	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,603	28.620	303,457.86	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	19.230	454,443.36	
RWE AG	38,604	40.180	1,551,108.72	
SNAM SPA	133,867	4.898	655,680.56	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	75,662	7.478	565,800.43	
UNIPER SE	4,697	6.505	30,553.98	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	42,162	24.370	1,027,487.94	
VERBUND AG	4,072	107.500	437,740.00	
BOLLORE SE	69,288	4.920	340,896.96	
PUBLICIS GROUPE	13,301	51.900	690,321.90	
SCOUT24 SE	4,671	55.660	259,987.86	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,745	41.510	196,964.95	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	44,422	22.055	979,727.21	
VIVENDI SE	38,496	9.258	356,395.96	
ユーロ小計	11,657,979		255,763,927.37 (34,717,395,501)	
合計	66,546,166		386,740,363,681 (386,740,363,681)	

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

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	603銘柄	69.9%	74.0%
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.6%	3.8%
オーストラリア・ドル	株式	50銘柄	2.0%	2.1%
香港・ドル	株式	28銘柄	0.8%	0.8%
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.3%	0.3%
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.0%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	80銘柄	4.3%	4.6%
イスラエル・シケル	株式	9銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	41銘柄	2.9%	3.1%

デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.8%	0.8%
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	47銘柄	1.0%	1.1%
ユーロ	株式	225銘柄	8.5%	9.0%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,490.00	1,407,472.20	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,093.00	761,122.84	
		AMERICAN TOWER CORP	27,357.00	7,409,096.31	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	90,010.00	619,268.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,137.00	1,740,829.78	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,604.00	875,500.64	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,009.00	847,869.90	
		CROWN CASTLE INTL CORP	25,936.00	4,685,597.76	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,562.00	2,193,636.90	
		DUKE REALTY CORP	21,667.00	1,355,487.52	
		EQUINIX INC	5,293.00	3,724,895.82	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,186.00	822,394.72	
		EQUITY RESIDENTIAL	22,609.00	1,772,319.51	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,691.00	1,057,582.23	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,530.00	1,616,605.60	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843.00	599,628.75	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756.00	794,528.28	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	46,189.00	822,626.09	
		INVITATION HOMES INC	36,871.00	1,439,075.13	
		IRON MOUNTAIN INC	15,785.00	765,414.65	
		KIMCO REALTY CORP	35,169.00	777,586.59	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858.00	549,231.92	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,678.00	1,240,304.94	
		PROLOGIS INC	44,406.00	5,886,459.36	
		PUBLIC STORAGE	9,559.00	3,120,153.19	
		REALTY INCOME CORP	36,686.00	2,714,397.14	
		REGENCY CENTERS CORP	8,289.00	534,060.27	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	6,447.00	2,164,838.13	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	20,565.00	2,234,181.60	
		SUN COMMUNITIES INC	7,129.00	1,168,870.84	
		UDR INC	20,610.00	997,524.00	
		VENTAS INC	23,363.00	1,256,462.14	
		VICI PROPERTIES INC	60,354.00	2,063,503.26	
VORNADO REALTY TRUST	8,706.00	264,575.34			
WELLTOWER INC	27,308.00	2,357,772.72			
WEYERHAEUSER CO	47,220.00	1,715,030.40			
WP CAREY INC	11,067.00	988,283.10			

アメリカ・ドル小計		841,032.00	65,344,188.37 (8,684,896,076)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,971.00	192,633.21	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	152,912.55	
カナダ・ドル小計		11,412.00	345,545.76 (35,850,373)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	75,718.00	882,114.70	
	DEXUS/AU	59,026.00	561,927.52	
	GOODMAN GROUP	95,350.00	1,973,745.00	
	GPT GROUP	121,221.00	551,555.55	
	LENDLEASE GROUP	36,263.00	372,421.01	
	MIRVAC GROUP	251,619.00	540,980.85	
	SCENTRE GROUP	350,311.00	1,015,901.90	
	STOCKLAND	127,393.00	490,463.05	
	TRANSURBAN GROUP	176,197.00	2,556,618.47	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	499,368.87	
オーストラリア・ドル小計		1,534,339.00	9,445,096.92 (876,599,445)	
香港・ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	193,500.00	1,373,850.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000.00	2,167,000.00	
	LINK REIT	136,600.00	8,974,620.00	
香港・ドル小計		527,100.00	12,515,470.00 (211,886,907)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	170,500.00	506,385.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	303,516.00	661,664.88	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	112,400.00	213,560.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	366,256.00	
シンガポール・ドル小計		794,516.00	1,747,865.88 (168,162,176)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	49,008.00	241,119.36	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861.00	291,463.63	
	SEGR0 PLC	78,831.00	863,199.45	
イギリス・ポンド小計		167,700.00	1,395,782.44 (225,809,683)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	147,220.20	
	GECINA SA	3,082.00	308,200.00	
	KLEPIERRE	13,600.00	294,440.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024.00	387,654.56	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,913.00	328,715.08	
ユーロ小計		36,007.00	1,466,229.84 (199,026,038)	
投資証券合計			10,402,230,699 (10,402,230,699)	
合計			10,402,230,699 (10,402,230,699)	

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

通貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	37銘柄	2.1%	83.5%
カナダ・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	0.3%
オーストラリア・ドル	投資証券	10銘柄	0.2%	8.4%
香港・ドル	投資証券	3銘柄	0.1%	2.0%
シンガポール・ドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.6%
イギリス・ポンド	投資証券	3銘柄	0.1%	2.2%
ユーロ	投資証券	5銘柄	0.0%	1.9%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2022年8月1日現在)

資産の部		
流動資産		
預金		3,390,144,901
金銭信託		4,689,943
コール・ローン		139,091,755
株式		15,542,211,819
投資信託受益証券		979,768,505
投資証券		1,529,945,424
派生商品評価勘定		14,054,569
未収入金		696,705
未収配当金		120,399,862
差入委託証拠金		1,016,758,545
流動資産合計		22,737,762,028
資産合計		22,737,762,028
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		16,526,991
未払金		4,874,497
その他未払費用		268
流動負債合計		21,401,756
負債合計		21,401,756
純資産の部		
元本等		
元本		13,881,494,339
剰余金		
剰余金又は欠損金()		8,834,865,933

元本等合計	22,716,360,272
純資産合計	22,716,360,272
負債純資産合計	22,737,762,028

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	13,881,494,339口

2. 1 単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6364円 (1万口当たりの純資産額16,364円)
-----------------	---

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年8月1日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT SEP22	4,665,338,371	-	4,664,778,820	559,551
	小計	4,665,338,371	-	4,664,778,820	559,551
合計		4,665,338,371	-	4,664,778,820	559,551

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	109,000,000	-	107,087,128	1,912,872
	小計	109,000,000	-	107,087,128	1,912,872
合計		109,000,000	-	107,087,128	1,912,872

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年8月3日

至 2022年8月1日

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

(その他の注記)

(2022年8月1日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	9,087,992,266円
同期中における追加設定元本額	6,665,433,136円
同期中における一部解約元本額	1,871,931,063円
2022年8月1日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	7,561,336,505円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,821,346,651円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	260,443,748円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	324,695,274円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	212,849,515円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	31,825,964円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	91,312,492円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	67,189,223円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	291,433,460円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	231,884,487円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	386,391,815円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	87,471,367円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,986,355円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	474,142,490円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	974,233,679円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	7,568,149円
SMA M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	53,383,165円
合計	13,881,494,339円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	22,300	1.575	35,122.50	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,068	5.440	22,129.92	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,785	49.800	88,893.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	8,850	25.590	226,471.50	
	LI AUTO INC - ADR	11,476	32.840	376,871.84	
	NIO INC - ADR	28,011	19.730	552,657.03	
	XPENG INC - ADR	8,879	24.430	216,913.97	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	4,086	38.350	156,698.10	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	7,046	4.920	34,666.32		

	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	11,556	25.780	297,913.68	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	8,933	48.710	435,126.43	
	PINDUODUO INC-ADR	9,357	49.010	458,586.57	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	9,463	9.160	86,681.08	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	10,343	1.620	16,755.66	
	BEIGENE LTD-ADR	985	168.080	165,558.80	
	HUTCHMED CHINA-ADR	1,444	13.070	18,873.08	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	969	47.240	45,775.56	
	ZAI LAB LTD-ADR	1,821	40.530	73,805.13	
	CREDICORP LTD	1,502	129.400	194,358.80	
	360 DIGITECH INC	1,578	14.520	22,912.56	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	18,837	4.580	86,273.46	
	KE HOLDINGS INC-ADR	6,927	14.110	97,739.97	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	24,280	0.879	21,342.12	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	10,530	3.351	35,286.03	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,234	64.700	79,839.80	
	AUTOHOME INC-ADR	1,588	35.690	56,675.72	
	IQIYI INC-ADR	7,166	3.820	27,374.12	
	JOYY INC-ADR	1,164	25.890	30,135.96	
	KANZHUN LTD - ADR	1,553	23.510	36,511.03	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	14,896	4.210	62,712.16	
	WEIBO CORP-SPON ADR	1,472	19.220	28,291.84	
	アメリカ・ドル小計	244,099		4,088,953.74 (543,462,842)	
香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	34,000	6.100	207,400.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	38,000	7.220	274,360.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	536,000	3.700	1,983,200.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	71,000	22.150	1,572,650.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	29,000	3.850	111,650.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	442,000	3.650	1,613,300.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	30,000	24.500	735,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	72,000	2.850	205,200.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	27,500	31.050	853,875.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	47,000	8.160	383,520.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	82,000	7.880	646,160.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	52,000	4.820	250,640.00	
	CMOC GROUP LTD-H	66,000	3.850	254,100.00	
	DONGYUE GROUP	24,000	8.530	204,720.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	8,400	70.950	595,980.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	20,000	9.610	192,200.00	
	MMG LTD	80,000	2.320	185,600.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	37,000	6.480	239,760.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	14,250	13.660	194,655.00		
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	33,000	7.500	247,500.00		

ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	120,000	9.190	1,102,800.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	51,000	4.190	213,690.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	66.700	233,450.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	54,000	3.200	172,800.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	34,500	15.240	525,780.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	23,000	9.630	221,490.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	80,000	4.680	374,400.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	42,000	8.150	342,300.00	
CITIC LTD	122,000	8.470	1,033,340.00	
CRRC CORP LTD - H	85,000	2.920	248,200.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	47,500	6.190	294,025.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	13,000	18.840	244,920.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.580	163,020.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	10,000	9.250	92,500.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	46,000	11.240	517,040.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	16,218	14.000	227,052.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	11,500	33.700	387,550.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	29,800	4.080	121,584.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	77,000	4.180	321,860.00	
AIR CHINA LTD-H	32,000	6.160	197,120.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	44,000	4.620	203,280.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,140	12.660	305,612.40	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	40,000	4.250	170,000.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	65,400	11.740	767,796.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	38,000	5.860	222,680.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	22,000	6.850	150,700.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,000	273.000	819,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	27,000	7.230	195,210.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.320	202,240.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	30,000	4.560	136,800.00	
BYD CO LTD-H	17,500	285.600	4,998,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	5.420	379,400.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	12,400	38.150	473,060.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	126,000	15.500	1,953,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	60,000	12.380	742,800.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	55,200	7.350	405,720.00	
MINH GROUP LTD	14,000	20.950	293,300.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	24,000	16.900	405,600.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	26,000	86.350	2,245,100.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	72,000	4.580	329,760.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	48,000	25.100	1,204,800.00	
LI NING CO LTD	50,500	63.600	3,211,800.00	
SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	17,400	82.550	1,436,370.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	33,000	12.760	421,080.00	

HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	21,000	15.660	328,860.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	16,000	17.080	273,280.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	31,800	21.700	690,060.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	25,600	15.000	384,000.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	318,200	93.100	29,624,420.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	100,000	4.720	472,000.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	12,000	19.020	228,240.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	96,000	2.270	217,920.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	23,450	59.500	1,395,275.00	
JD.COM INC - CL A	42,085	233.800	9,839,473.00	
MEITUAN-CLASS B	85,800	176.300	15,126,540.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	13,500	20.550	277,425.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	11,800	18.000	212,400.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	6.540	320,460.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	12,500	44.850	560,625.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,300	119.980	275,954.00	
CHINA FEIHE LTD	75,000	6.900	517,500.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	68,000	36.400	2,475,200.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	34,000	54.200	1,842,800.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	51,000	3.740	190,740.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	37,000	47.000	1,739,000.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	35,000	18.200	637,000.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	40,000	12.920	516,800.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	12,000	76.650	919,800.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	28,000	7.170	200,760.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	100,000	6.380	638,000.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	23.050	207,450.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	15,000	37.950	569,250.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	20.850	83,400.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	5,600	45.150	252,840.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	6.100	122,000.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	9,000	18.540	166,860.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	50,400	9.800	493,920.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,600	11.820	196,212.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	25,200	18.000	453,600.00	
3SBIO INC	30,500	5.220	159,210.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	2,600	65.800	171,080.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	27,000	12.500	337,500.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	42,000	3.330	139,860.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	188,800	8.590	1,621,792.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	24,000	28.400	681,600.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	2,500	81.350	203,375.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	24,000	15.300	367,200.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	23,000	32.750	753,250.00	

PHARMARON BEIJING CO LTD-H	5,100	63.950	326,145.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10,500	28.400	298,200.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	230,000	4.540	1,044,200.00
WUXI APPTec CO LTD-H	6,911	95.000	656,545.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	76,000	74.550	5,665,800.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	613,000	2.590	1,587,670.00
BANK OF CHINA LTD-H	1,667,000	2.790	4,650,930.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	184,000	4.670	859,280.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	187,000	3.280	613,360.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,018,000	5.010	10,110,180.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.380	183,260.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	82,000	42.400	3,476,800.00
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	131,100	2.560	335,616.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,184,000	4.150	4,913,600.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	167,000	5.190	866,730.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	188,000	1.080	203,040.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	58,500	3.880	226,980.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	32,000	14.420	461,440.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	48,000	16.120	773,760.00
FAR EAST HORIZON LTD	28,000	6.470	181,160.00
GF SECURITIES CO LTD-H	17,000	10.380	176,460.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	60,800	5.250	319,200.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	32,400	10.340	335,016.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	156,000	11.680	1,822,080.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	55,400	16.760	928,504.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	35,400	8.270	292,758.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	17,100	18.720	320,112.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	174,000	2.350	408,900.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	144,000	8.060	1,160,640.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	134,000	46.200	6,190,800.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	14,900	19.960	297,404.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES	18,250	9.590	175,017.50
CHINA EVERGRANDE GROUP	66,000	1.650	108,900.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	96,000	1.820	174,720.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	80,500	21.650	1,742,825.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	30,000	8.200	246,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	68,000	32.750	2,227,000.00
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	15,800	33.300	526,140.00
CHINA VANKE CO LTD-H	39,200	14.940	585,648.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	10,000	5.660	56,600.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	104,000	2.130	221,520.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	170,000	3.030	515,100.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	44,000	17.480	769,120.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	22,500	15.500	348,750.00

GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	34,000	7.010	238,340.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	12,100	10.380	125,598.00	
LOGAN GROUP CO LTD	16,000	2.180	34,880.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	38,000	26.200	995,600.00	
SEAZEN GROUP LTD	32,000	2.690	86,080.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	18,500	4.420	81,770.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	53,000	4.580	242,740.00	
WHARF HOLDINGS LTD	23,000	28.700	660,100.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	29,600	9.800	290,080.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	66,000	6.710	442,860.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	18,300	26.100	477,630.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	50,000	16.960	848,000.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	7.210	86,520.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	21,000	13.020	273,420.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	13,500	15.180	204,930.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	13,000	20.150	261,950.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,500	22.950	309,825.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	21,000	7.190	150,990.00	
LENOVO GROUP LTD	152,000	7.590	1,153,680.00	
SUNNY OPTICAL TECH	15,000	106.100	1,591,500.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	325,400	12.340	4,015,436.00	
ZTE CORP-H	16,600	16.880	280,208.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	9,000	28.500	256,500.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	14,000	23.500	329,000.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	102,000	13.340	1,360,680.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	930,000	1.010	939,300.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	10,500	25.150	264,075.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	100,000	2.380	238,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	229,000	1.810	414,490.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	64,000	12.080	773,120.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	70,000	12.560	879,200.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	112,000	4.440	497,280.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	20,000	32.950	659,000.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	40,000	14.760	590,400.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	16,600	127.900	2,123,140.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	62,000	7.650	474,300.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	76,000	3.750	285,000.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	78,000	5.780	450,840.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	260,000	0.670	174,200.00	
BAIDU INC-CLASS A	46,800	132.500	6,201,000.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	3,860	188.800	728,768.00	
CHINA LITERATURE LTD	6,800	30.950	210,460.00	
KINGSOFT CORP LTD	20,200	26.250	530,250.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	37,400	79.000	2,954,600.00	

	NETEASE INC	43,500	144.700	6,294,450.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	131,200	306.800	40,252,160.00	
	香港・ドル小計	17,546,664		254,660,690.90 (4,311,405,497)	
台湾・ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	24,000	84.500	2,028,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	48,000	41.450	1,989,600.00	
	CHINA STEEL CORP	248,000	27.700	6,869,600.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	74,000	70.000	5,180,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	87,000	92.000	8,004,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	97,000	67.300	6,528,100.00	
	TAIWAN CEMENT	127,676	38.750	4,947,445.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,000	817.000	2,451,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	67,000	30.400	2,036,800.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,460.000	1,460,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	55,000	33.900	1,864,500.00	
	CHINA AIRLINES LTD	63,000	22.600	1,423,800.00	
	EVA AIRWAYS CORP	59,000	33.900	2,000,100.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	54,740	95.500	5,227,670.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	41,000	29.250	1,199,250.00	
	WAN HAI LINES LTD	14,605	107.000	1,562,735.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	37,000	89.600	3,315,200.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	35.450	1,063,500.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,000	408.000	1,632,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	7,640	167.000	1,275,880.00	
	GIANT MANUFACTURING	7,000	244.000	1,708,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	286.500	859,500.00	
	POU CHEN	39,000	26.800	1,045,200.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	6,000	604.000	3,624,000.00	
	MOMO.COM INC	1,200	817.000	980,400.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	13,000	283.000	3,679,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	101,000	70.400	7,110,400.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	98,754	17.800	1,757,821.20	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	368,000	22.950	8,445,600.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	276,669	27.500	7,608,397.50	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	217,792	27.000	5,880,384.00	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	179,855	23.100	4,154,650.50	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	228,000	35.400	8,071,200.00	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	197,760	16.900	3,342,144.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	215,958	15.700	3,390,540.60		
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	200,105	27.400	5,482,877.00		
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	79,299	50.100	3,972,879.90		
CHAILEASE HOLDING CO LTD	28,836	211.500	6,098,814.00		
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	204,160	20.000	4,083,200.00		
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	166,000	45.500	7,553,000.00		

CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	325,196	12.900	4,195,028.40	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	149,000	56.100	8,358,900.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	252,432	8.550	2,158,293.60	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	24,180	54.800	1,325,064.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	10,000	248.000	2,480,000.00	
ACER INC	61,000	22.600	1,378,600.00	
ADVANTECH CO LTD	9,299	342.500	3,184,907.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	15,000	281.500	4,222,500.00	
AUO CORP	172,000	13.350	2,296,200.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	14,000	170.500	2,387,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	88,000	22.800	2,006,400.00	
DELTA ELECTRONICS INC	41,000	258.000	10,578,000.00	
E INK HOLDINGS INC	17,000	195.500	3,323,500.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	261,800	109.000	28,536,200.00	
INNOLUX CORP	211,000	10.300	2,173,300.00	
INVENTEC CORP	42,000	23.700	995,400.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,080	2,090.000	4,347,200.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	42,000	65.300	2,742,600.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	14,000	118.000	1,652,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	4,000	240.500	962,000.00	
PEGATRON CORP	42,000	62.200	2,612,400.00	
QUANTA COMPUTER INC	57,000	84.600	4,822,200.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	28,000	55.300	1,548,400.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	27,000	158.500	4,279,500.00	
WIWYNN CORP	2,000	736.000	1,472,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	33,520	50.200	1,682,704.00	
YAGEO CORPORATION	9,198	342.000	3,145,716.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	14,000	113.000	1,582,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	69,000	86.400	5,961,600.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	973.000	486,500.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	1,185.000	1,185,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	5,000	454.000	2,270,000.00	
MEDIATEK INC	32,000	683.000	21,856,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	26,000	52.300	1,359,800.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	12,000	265.000	3,180,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,000	1,125.000	2,250,000.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	59,000	35.250	2,079,750.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	10,000	342.000	3,420,000.00	
SILERGY CORP	6,800	556.000	3,780,800.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	517,000	509.000	263,153,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	249,000	40.150	9,997,350.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	19,000	72.000	1,368,000.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	159.000	954,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	61,000	23.150	1,412,150.00	

	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	80,000	121.500	9,720,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	36,000	75.500	2,718,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	38,000	101.500	3,857,000.00	
	台湾・ドル小計	6,971,054		602,364,152.20 (2,675,340,146)	
エジプト・ポンド	EASTERN CO SAE	13,558	9.750	132,190.50	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	37,184	38.370	1,426,750.08	
	EFG-HERMES HOLDING SAE	15,925	11.840	188,552.00	
	エジプト・ポンド小計	66,667		1,747,492.58 (12,268,971)	
トルコ・リラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,650	268.400	711,260.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	25,680	27.620	709,281.60	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	19,291	22.200	428,260.20	
	KOC HOLDING AS	15,538	36.800	571,798.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	22,434	21.820	489,509.88	
	TURK HAVA YOLLARI AO	13,066	50.400	658,526.40	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,688	302.800	511,126.40	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,767	92.100	807,440.70	
	AKBANK T.A.S.	70,766	8.630	610,710.58	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,103	19.870	538,536.61	
	TURKIYE IS BANKASI-C	49,752	5.220	259,705.44	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	27,080	16.920	458,193.60	
	トルコ・リラ小計	283,815		6,754,349.81 (50,108,495)	
メキシコ・ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	65,400	80.600	5,271,240.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,095	205.080	634,722.60	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	20,300	44.960	912,688.00	
	ALFA S.A.B.-A	49,200	14.010	689,292.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,700	79.510	612,227.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	8,000	276.400	2,211,200.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	4,070	384.000	1,562,880.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,105	147.040	750,639.20	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	111,900	73.840	8,262,696.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	9,300	141.210	1,313,253.00	
	GRUMA S.A.B.-B	3,575	253.490	906,226.75	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,200	72.040	1,887,448.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	31,900	30.020	957,638.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	54,500	115.990	6,321,455.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	45,000	37.540	1,689,300.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	591,400	19.400	11,473,160.00	
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	30,400	23.860	725,344.00		
	メキシコ・ペソ小計	1,067,045		46,181,409.55 (301,195,153)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,090	57.050	2,401,234.50	
	AYALA CORPORATION	4,660	620.000	2,889,200.00	

	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,310	453.400	593,954.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	56,042	51.500	2,886,163.00	
	SM INVESTMENTS CORP	5,405	775.500	4,191,577.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	23,130	194.200	4,491,846.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	7,480	201.200	1,504,976.00	
	MONDE NISSIN CORP	155,700	14.240	2,217,168.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,230	111.000	1,912,530.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	33,757	93.000	3,139,401.00	
	BDO UNIBANK INC	43,680	119.500	5,219,760.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	38,980	48.600	1,894,428.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	3.690	409,221.00	
	AYALA LAND INC	158,000	25.250	3,989,500.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	242,400	36.600	8,871,840.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	47,400	19.000	900,600.00	
	GLOBE TELECOM INC	620	2,062.000	1,278,440.00	
	PLDT INC	2,005	1,656.000	3,320,280.00	
	ACEN CORP	141,680	8.370	1,185,861.60	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	5,120	340.000	1,740,800.00	
	フィリピン・ペソ小計	1,137,589		55,038,780.60 (132,621,446)	
チリ・ペソ	EMPRESAS COPEC SA	8,012	7,380.000	59,128,560.00	
	EMPRESAS CMPC SA	22,543	1,531.000	34,513,333.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	3,060	89,499.000	273,866,940.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	374,056	97.500	36,470,460.00	
	FALABELLA SA	15,911	2,010.000	31,981,110.00	
	CENCOSUD SA	28,071	1,231.000	34,555,401.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,586	5,200.000	8,247,200.00	
	BANCO DE CHILE	1,024,325	85.500	87,579,787.50	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,001	27,188.000	27,215,188.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,209,844	35.690	43,179,332.36	
	ENEL AMERICAS SA	408,318	91.200	37,238,601.60	
	ENEL CHILE SA	364,877	25.800	9,413,826.60	
	チリ・ペソ小計	3,461,604		683,389,740.06 (100,768,551)	
コロンビア・ペソ	ECOPETROL SA	92,687	2,280.000	211,326,360.00	
	BANCOLOMBIA SA	5,994	35,990.000	215,724,060.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	8,412	31,620.000	265,987,440.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,110	20,600.000	167,066,000.00	
	コロンビア・ペソ小計	115,203		860,103,860.00 (26,605,593)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	18,154	330.300	5,996,266.20	
	COAL INDIA LTD	32,336	211.250	6,830,980.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	10,662	241.150	2,571,141.30	
	INDIAN OIL CORP LTD	66,526	72.950	4,853,071.70	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	49,390	134.150	6,625,668.50	

PETRONET LNG LTD	12,527	219.950	2,755,313.65
RELIANCE INDUSTRIES LTD	63,892	2,509.450	160,333,779.40
ACC LTD	1,628	2,227.400	3,626,207.20
AMBUJA CEMENTS LTD	11,609	374.800	4,351,053.20
ASIAN PAINTS LTD	8,051	3,333.750	26,840,021.25
BERGER PAINTS INDIA LTD	4,056	624.700	2,533,783.20
GRASIM INDUSTRIES LTD	5,159	1,573.000	8,115,107.00
HINDALCO INDUSTRIES LTD	29,822	415.050	12,377,621.10
JINDAL STEEL & POWER LTD	8,561	389.050	3,330,657.05
JSW STEEL LTD	16,324	629.600	10,277,590.40
PI INDUSTRIES LTD	1,393	3,089.900	4,304,230.70
PIDILITE INDUSTRIES LTD	3,200	2,451.250	7,844,000.00
SHREE CEMENT LTD	227	20,498.000	4,653,046.00
SRF LTD	3,336	2,428.300	8,100,808.80
TATA STEEL LTD	153,800	107.600	16,548,880.00
ULTRATECH CEMENT LTD	2,121	6,544.800	13,881,520.80
UPL LTD	10,423	741.100	7,724,485.30
VEDANTA LTD	15,567	254.300	3,958,688.10
ADANI ENTERPRISES LTD	5,771	2,569.200	14,826,853.20
BHARAT ELECTRONICS LTD	24,926	275.200	6,859,635.20
HAVELLS INDIA LTD	5,714	1,249.350	7,138,785.90
LARSEN & TOUBRO LTD	14,787	1,808.050	26,735,635.35
SIEMENS LTD	1,495	2,694.200	4,027,829.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,007	637.100	2,552,859.70
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	10,713	763.700	8,181,518.10
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	6,593	712.750	4,699,160.75
INTERGLOBE AVIATION LTD	2,035	1,867.950	3,801,278.25
BAJAJ AUTO LTD	1,601	3,914.450	6,267,034.45
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,453	2,311.250	3,358,246.25
BHARAT FORGE LTD	5,374	733.000	3,939,142.00
EICHER MOTORS LTD	2,869	3,093.450	8,875,108.05
HERO MOTOCORP LTD	2,307	2,818.050	6,501,241.35
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	18,265	1,164.450	21,268,679.25
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,555	8,773.550	22,416,420.25
MRF LTD	32	83,818.150	2,682,180.80
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	21,100	127.300	2,686,030.00
TATA MOTORS LTD	34,849	449.600	15,668,110.40
PAGE INDUSTRIES LTD	115	48,873.000	5,620,395.00
TITAN CO LTD	7,453	2,352.050	17,529,828.65
JUBILANT FOODWORKS LTD	9,393	550.250	5,168,498.25
TRENT LTD	4,308	1,268.600	5,465,128.80
ZOMATO LTD	26,199	46.800	1,226,113.20
AVENUE SUPERMARTS LTD	3,399	4,243.850	14,424,846.15
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,431	3,900.400	9,481,872.40

ITC LTD	64,153	303.050	19,441,566.65
MARICO LTD	10,852	518.000	5,621,336.00
NESTLE INDIA LTD	708	19,359.100	13,706,242.80
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	11,704	811.650	9,499,551.60
UNITED SPIRITS LTD	6,100	779.000	4,751,900.00
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,569	1,586.550	4,075,846.95
DABUR INDIA LTD	12,986	584.100	7,585,122.60
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	8,584	853.750	7,328,590.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	17,497	2,637.400	46,146,587.80
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,958	4,212.300	8,247,683.40
AUROBINDO PHARMA LTD	4,893	547.000	2,676,471.00
BIOCON LTD	7,019	307.200	2,156,236.80
CIPLA LTD	10,160	977.400	9,930,384.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,941	3,831.650	11,268,882.65
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,572	4,090.350	10,520,380.20
LUPIN LTD	4,861	644.100	3,130,970.10
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	20,531	943.200	19,364,839.20
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	1,696	1,528.800	2,592,844.80
AU SMALL FINANCE BANK LTD	3,304	592.050	1,956,133.20
AXIS BANK LTD	48,437	724.750	35,104,715.75
BANDHAN BANK LTD	13,522	276.200	3,734,776.40
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	36,362	2,377.800	86,461,563.60
ICICI BANK LTD	108,637	818.600	88,930,248.20
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	11,661	1,810.350	21,110,491.35
STATE BANK OF INDIA	37,463	528.350	19,793,576.05
YES BANK LTD	188,310	14.950	2,815,234.50
BAJAJ FINANCE LTD	5,787	7,209.100	41,719,061.70
BAJAJ FINSERV LTD	802	15,047.600	12,068,175.20
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	8,282	700.700	5,803,197.40
MUTHOOT FINANCE LTD	2,010	1,065.650	2,141,956.50
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,439	1,770.050	4,317,151.95
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,949	939.250	4,648,348.25
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,367	1,379.750	4,645,618.25
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	19,953	555.500	11,083,891.50
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	5,048	1,219.900	6,158,055.20
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	7,542	553.600	4,175,251.20
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	9,448	1,294.400	12,229,491.20
DLF LTD	12,988	385.950	5,012,718.60
GODREJ PROPERTIES LTD	2,089	1,507.600	3,149,376.40
HCL TECHNOLOGIES LTD	22,783	948.400	21,607,397.20
INFOSYS LTD	70,622	1,549.700	109,442,913.40
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	1,236	4,730.750	5,847,207.00
MINDTREE LTD	1,384	3,413.500	4,724,284.00
MPHASIS LTD	1,773	2,299.800	4,077,545.40

	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	19,410	3,301.900	64,089,879.00	
	TATA ELXSI LTD	719	8,690.050	6,248,145.95	
	TECH MAHINDRA LTD	11,940	1,048.650	12,520,881.00	
	WIPRO LTD	28,671	423.700	12,147,902.70	
	BHARTI AIRTEL LTD	46,084	677.950	31,242,647.80	
	INDUS TOWERS LTD	16,890	222.550	3,758,869.50	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	6,566	2,174.700	14,279,080.20	
	ADANI POWER LTD	16,185	313.950	5,081,280.75	
	ADANI TOTAL GAS LTD	5,771	3,127.200	18,047,071.20	
	ADANI TRANSMISSION LTD	5,771	3,109.600	17,945,501.60	
	GAIL INDIA LTD	32,618	146.600	4,781,798.80	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	6,611	346.350	2,289,719.85	
	NTPC LTD	84,726	152.950	12,958,841.70	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	65,881	213.950	14,095,239.95	
	TATA POWER CO LTD	30,179	221.900	6,696,720.10	
	INFO EDGE INDIA LTD	1,370	4,336.400	5,940,868.00	
	インド・ルピー小計	1,949,882		1,502,764,615.60 (2,524,644,554)	
インドネ シア・ル ピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	263,900	3,250.000	857,675,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	38,700	32,300.000	1,250,010,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	171,600	1,845.000	316,602,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	128,000	1,955.000	250,240,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	626,800	900.000	564,120,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	57,500	7,600.000	437,000,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	253,061	4,060.000	1,027,427,660.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	43,500	6,525.000	283,837,500.00	
	VALE INDONESIA TBK	52,100	6,100.000	317,810,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	424,800	6,325.000	2,686,860,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	410,100	1,875.000	768,937,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	175,400	5,600.000	982,240,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	10,800	27,850.000	300,780,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	39,000	8,825.000	344,175,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	87,700	6,800.000	596,360,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	182,700	4,510.000	823,977,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	410,000	1,620.000	664,200,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,178,400	7,350.000	8,661,240,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	82,300	10,575.000	870,322,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	391,800	8,275.000	3,242,145,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	156,600	7,850.000	1,229,310,000.00		
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,455,300	4,360.000	6,345,108,000.00		
SARANA MENARA NUSANTARA PT	516,500	1,175.000	606,887,500.00		
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,039,600	4,230.000	4,397,508,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	118,900	3,070.000	365,023,000.00		
	インドネシア・ルピア小計	8,315,061		38,189,795,660.00	

				(343,708,161)	
ブラジ ル・レア ル	COSAN SA	27,188	18.670	507,599.96	
	PETRO RIO SA	14,300	24.220	346,346.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	78,300	36.960	2,893,968.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	99,900	34.150	3,411,585.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	17,600	12.690	223,344.00	
	BRASKEM SA-PREF A	4,000	36.690	146,760.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	14,600	14.710	214,766.00	
	GERDAU SA-PREF	24,100	24.460	589,486.00	
	SUZANO SA	15,715	48.290	758,877.35	
	VALE SA	84,388	69.750	5,886,063.00	
	WEG SA	35,260	28.040	988,690.40	
	CCR SA	23,400	12.990	303,966.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	15,730	57.610	906,205.30	
	RUMO SA	27,200	17.540	477,088.00	
	AMERICANAS SA	13,024	14.000	182,336.00	
	LOJAS RENNER S.A.	20,758	25.290	524,969.82	
	MAGAZINE LUIZA SA	54,700	2.580	141,126.00	
	VIBRA ENERGIA SA	24,480	16.650	407,592.00	
	ATACADAO SA	8,100	18.630	150,903.00	
	RAIA DROGASIL SA	24,200	20.980	507,716.00	
	AMBEV SA	99,100	14.930	1,479,563.00	
	BRF SA	15,000	15.960	239,400.00	
	JBS SA	18,400	31.940	587,696.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	16,300	15.580	253,954.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	97,419	6.160	600,101.04	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	7,400	32.390	239,686.00	
	HYPERA SA	8,600	42.590	366,274.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	35,781	14.470	517,751.07	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	111,936	17.430	1,951,044.48	
	BANCO DO BRASIL S.A.	16,800	35.970	604,296.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	103,000	23.620	2,432,860.00	
	ITAUSA SA	97,369	8.630	840,294.47	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	128,600	11.090	1,426,174.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	14,700	28.990	426,153.00	
	TOTVS SA	11,000	26.370	290,070.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	11,300	44.600	503,980.00	
TIM SA	18,200	12.590	229,138.00		
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	22,105	45.810	1,012,630.05		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	5,700	47.330	269,781.00		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	29,199	11.240	328,196.76		
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	7,200	44.670	321,624.00		
CPFL ENERGIA SA	4,800	32.840	157,632.00		
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,250	44.320	188,360.00		

	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	22,800	24.810	565,668.00	
	ブラジル・リアル小計	1,533,902		35,401,714.70 (909,321,362)	
チェコ・ コロナ	KOMERCNI BANKA AS	1,821	608.000	1,107,168.00	
	MONETA MONEY BANK AS	4,790	80.200	384,158.00	
	CEZ AS	3,391	1,093.000	3,706,363.00	
	チェコ・コロナ小計	10,002		5,197,689.00 (28,690,724)	
韓国・ ウォン	HD HYUNDAI	932	56,900.000	53,030,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,207	187,500.000	226,312,500.00	
	S-OIL CORP	945	91,800.000	86,751,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,623	43,800.000	114,887,400.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,821	34,100.000	62,096,100.00	
	KOREA ZINC CO LTD	178	477,500.000	84,995,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	305	129,500.000	39,497,500.00	
	LG CHEM LTD	1,053	603,000.000	634,959,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	128	291,000.000	37,248,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	360	176,500.000	63,540,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	641	131,500.000	84,291,500.00	
	POSCO HOLDINGS INC	1,678	242,000.000	406,076,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD	144	105,000.000	15,120,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	526	81,800.000	43,026,800.00	
	SKC CO LTD	496	136,000.000	67,456,000.00	
	CJ CORP	168	79,800.000	13,406,400.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	1,293	31,100.000	40,212,300.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	8,409	18,750.000	157,668,750.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,016	119,400.000	121,310,400.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,373	29,800.000	40,915,400.00	
	GS HOLDINGS	1,178	41,650.000	49,063,700.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,849	42,150.000	77,935,350.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	448	125,000.000	56,000,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,568	57,000.000	89,376,000.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	891	84,700.000	75,467,700.00	
	LG CORP	1,981	81,100.000	160,659,100.00	
	LG ENERGY SOLUTION	463	422,000.000	195,386,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	1,765	120,500.000	212,682,500.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,973	19,600.000	58,270,800.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	14,496	5,620.000	81,467,520.00	
SK INC	731	220,000.000	160,820,000.00		
S-1 CORPORATION	219	63,800.000	13,972,200.00		
CJ LOGISTICS	235	116,500.000	27,377,500.00		
HMM CO LTD	5,645	24,850.000	140,278,250.00		
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	364	182,000.000	66,248,000.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	3,650	25,300.000	92,345,000.00		

PAN OCEAN CO LTD	4,527	5,650.000	25,577,550.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,442	34,800.000	50,181,600.00	
HANON SYSTEMS	4,138	10,650.000	44,069,700.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,252	228,500.000	286,082,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,963	196,000.000	580,748,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	863	94,200.000	81,294,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	582	94,100.000	54,766,200.00	
KIA CORP	5,530	81,200.000	449,036,000.00	
COWAY CO LTD	1,284	64,100.000	82,304,400.00	
F&F CO LTD / NEW	290	149,500.000	43,355,000.00	
HLB INC	2,030	41,950.000	85,158,500.00	
LG ELECTRONICS INC	2,233	94,400.000	210,795,200.00	
KANGWON LAND INC	2,078	25,900.000	53,820,200.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	680	71,800.000	48,824,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	172	95,400.000	16,408,800.00	
BGF RETAIL CO LTD	193	181,000.000	34,933,000.00	
E-MART INC	516	113,000.000	58,308,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	174	391,500.000	68,121,000.00	
KT&G CORP	2,245	81,900.000	183,865,500.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	373	100,500.000	37,486,500.00	
AMOREPACIFIC CORP	583	129,000.000	75,207,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	473	36,900.000	17,453,700.00	
LG H&H	181	779,000.000	140,999,000.00	
LG H&H-PRF	35	378,500.000	13,247,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,790	72,400.000	129,596,000.00	
SD BIOSENSOR INC	604	40,300.000	24,341,200.00	
ALTEOGEN INC	735	65,200.000	47,922,000.00	
CELLTRION INC	2,067	190,000.000	392,730,000.00	
CELLTRION PHARM INC	347	84,700.000	29,390,900.00	
GREEN CROSS CORP	79	173,000.000	13,667,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	171	309,500.000	52,924,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	376	865,000.000	325,240,000.00	
SEEGENE INC	713	39,700.000	28,306,100.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	657	78,000.000	51,246,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	550	122,000.000	67,100,000.00	
YUHAN CORP	1,226	57,800.000	70,862,800.00	
HANA FINANCIAL GROUP	6,302	37,200.000	234,434,400.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	5,467	9,390.000	51,335,130.00	
KAKAOBANK CORP	2,498	30,900.000	77,188,200.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	8,442	48,450.000	409,014,900.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	9,968	35,700.000	355,857,600.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	9,935	11,900.000	118,226,500.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	873	63,100.000	55,086,300.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	824	26,250.000	21,630,000.00	

MERITZ SECURITIES CO LTD	5,528	4,850.000	26,810,800.00		
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	4,496	6,590.000	29,628,640.00		
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,376	9,950.000	23,641,200.00		
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,312	35,000.000	45,920,000.00		
DB INSURANCE CO LTD	912	60,600.000	55,267,200.00		
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	969	34,500.000	33,430,500.00		
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	646	197,500.000	127,585,000.00		
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,679	60,700.000	101,915,300.00		
SAMSUNG SDS CO LTD	731	136,000.000	99,416,000.00		
ILJIN MATERIALS CO LTD	385	73,500.000	28,297,500.00		
L&F CO LTD	475	228,700.000	108,632,500.00		
LG DISPLAY CO LTD	4,881	15,300.000	74,679,300.00		
LG INNOTEK CO LTD	298	363,000.000	108,174,000.00		
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,176	142,500.000	167,580,000.00		
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	100,372	61,400.000	6,162,840,800.00		
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	17,420	57,000.000	992,940,000.00		
SAMSUNG SDI CO LTD	1,155	569,000.000	657,195,000.00		
SK HYNIX INC	11,544	97,900.000	1,130,157,600.00		
SK SQUARE CO LTD	1,963	42,750.000	83,918,250.00		
LG UPLUS CORP	4,555	12,500.000	56,937,500.00		
SK TELECOM	352	53,600.000	18,867,200.00		
KOREA ELECTRIC POWER CORP	5,778	22,350.000	129,138,300.00		
CHEIL WORLDWIDE INC	1,193	22,800.000	27,200,400.00		
CJ ENM CO LTD	144	101,600.000	14,630,400.00		
HYBE CO LTD	332	175,500.000	58,266,000.00		
KAKAO CORP	6,552	74,800.000	490,089,600.00		
KAKAO GAMES CORP	734	50,700.000	37,213,800.00		
KRAFTON INC	515	233,500.000	120,252,500.00		
NAVER CORP	2,787	259,000.000	721,833,000.00		
NCSOFT CORP	321	372,500.000	119,572,500.00		
NETMARBLE CORP	337	72,100.000	24,297,700.00		
PEARL ABYSS CORP	498	53,300.000	26,543,400.00		
韓国・ウォン小計	334,629		21,151,164,840.00 (2,151,073,464)		
マレーシ ア・リン ギット	DIALOG GROUP BHD	66,000	2.210	145,860.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,000	22.400	112,000.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	53,500	8.880	475,080.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	82,100	4.860	399,006.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	8,100	7.560	61,236.00	
	SIME DARBY BERHAD	47,100	2.340	110,214.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	14,700	6.250	91,875.00	
	MISC BHD	28,500	7.210	205,485.00	
	GENTING BHD	41,600	4.730	196,768.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	73,100	2.920	213,452.00	

	MR DIY GROUP M BHD	63,450	2.220	140,859.00	
	IOI CORP BHD	49,500	4.030	199,485.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,600	21.920	188,512.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,500	134.700	202,050.00	
	PPB GROUP BERHAD	13,340	16.280	217,175.20	
	QL RESOURCES BHD	29,250	5.300	155,025.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	37,800	4.360	164,808.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	37,700	2.740	103,298.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	41,700	6.390	266,463.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	97,900	0.965	94,473.50	
	AMMB HOLDINGS BHD	39,300	3.900	153,270.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	145,700	5.210	759,097.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	13,400	20.980	281,132.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,700	19.480	111,036.00	
	MALAYAN BANKING BHD	103,200	8.860	914,352.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	312,500	4.640	1,450,000.00	
	RHB BANK BHD	28,900	5.880	169,932.00	
	INARI AMERTRON BHD	52,900	2.860	151,294.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	52,900	2.870	151,823.00	
	DIGI.COM BHD	58,600	3.630	212,718.00	
	MAXIS BHD	39,200	3.670	143,864.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	16,000	5.680	90,880.00	
	PETRONAS GAS BHD	14,900	17.140	255,386.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	57,500	8.260	474,950.00	
	マレーシア・リングット小計	1,741,140		9,062,858.70 (270,516,363)	
南アフリ カ・ラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	5,088	201.890	1,027,216.32	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,473	233.810	578,212.13	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,114	1,271.140	1,416,049.96	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	8,767	246.140	2,157,909.38	
	GOLD FIELDS LTD	18,706	154.010	2,880,911.06	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	11,645	52.910	616,136.95	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	17,796	184.550	3,284,251.80	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,182	492.550	582,194.10	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	7,076	176.420	1,248,347.92	
	SASOL LTD	11,884	349.650	4,155,240.60	
	SIBANYE STILLWATER LTD	58,944	40.520	2,388,410.88	
	BIDVEST GROUP LTD	6,070	213.780	1,297,644.60	
	MR PRICE GROUP LTD	5,391	180.130	971,080.83	
	NASPERS LTD-N SHS	4,570	2,356.430	10,768,885.10	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	35,012	20.200	707,242.40	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	6,946	121.340	842,827.64	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	20,973	52.870	1,108,842.51	
BID CORP LTD	7,040	306.000	2,154,240.00		

	CLICKS GROUP LTD	5,198	279.810	1,454,452.38	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	10,550	224.240	2,365,732.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	4,180	134.260	561,206.80	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	8,143	145.200	1,182,363.60	
	ABSA GROUP LTD	16,903	170.020	2,873,848.06	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,828	1,992.030	3,641,430.84	
	NEDBANK GROUP LTD	9,613	216.900	2,085,059.70	
	STANDARD BANK GROUP LTD	28,175	159.990	4,507,718.25	
	FIRSTRAND LTD	105,963	65.550	6,945,874.65	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,879	288.970	831,944.63	
	REMGRO LTD	11,107	136.650	1,517,771.55	
	DISCOVERY LTD	10,530	128.290	1,350,893.70	
	OLD MUTUAL LTD	98,823	11.340	1,120,652.82	
	SANLAM LTD	37,393	54.510	2,038,292.43	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	8,918	91.620	817,067.16	
	MTN GROUP LTD	35,593	139.090	4,950,630.37	
	VODACOM GROUP LTD	14,133	137.930	1,949,364.69	
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,894	119.020	939,543.88	
	南アフリカ・ランド小計	648,500		79,319,491.69 (633,762,739)	
タイ・ パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	29,200	162.500	4,745,000.00	
	PTT PCL-NVDR	212,700	34.750	7,391,325.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	24,800	51.250	1,271,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	35,700	43.750	1,561,875.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	44,800	44.250	1,982,400.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	27,300	51.000	1,392,300.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	16,400	373.000	6,117,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	93,500	70.250	6,568,375.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	126,600	8.700	1,101,420.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	131,900	8.600	1,134,340.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	184,500	5.000	922,500.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	72,700	33.500	2,435,450.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	36,791	36.500	1,342,871.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	114,300	13.300	1,520,190.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	72,100	25.250	1,820,525.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	19,000	32.500	617,500.00	
	CP ALL PCL-NVDR	122,600	61.250	7,509,250.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	5,400	112.500	607,500.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	73,500	25.250	1,855,875.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	38,500	31.250	1,203,125.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	58,800	16.300	958,440.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	226,400	26.750	6,056,200.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	11,400	182.000	2,074,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	58,400	15.900	928,560.00	

	SCB X PCL-NVDR	15,400	101.500	1,563,100.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	43,300	16.900	731,770.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	16,600	74.750	1,240,850.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,300	57.250	818,675.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,200	48.250	781,650.00	
	SRI SAWAD CORP PCL-NVDR	11,800	49.750	587,050.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	46,300	63.500	2,940,050.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	176,900	8.500	1,503,650.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,700	474.000	2,701,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	25,000	201.000	5,025,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	27,000	70.000	1,890,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	259,200	4.740	1,228,608.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	20,900	38.000	794,200.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	5,500	185.000	1,017,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	35,200	81.250	2,860,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	14,800	67.750	1,002,700.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	61,600	47.250	2,910,600.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	19,600	38.250	749,700.00	
	タイ・パーツ小計	2,652,591		93,464,924.50 (342,081,624)	
ポーランド・ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	8,543	75.520	645,167.36	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	36,383	6.918	251,697.59	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,754	115.450	317,949.30	
	LPP SA	23	9,885.000	227,355.00	
	ALLEGRO.EU SA	6,626	25.035	165,881.91	
	DINO POLSKA SA	1,029	361.500	371,983.50	
	BANK PEKAO SA	3,856	73.200	282,259.20	
	MBANK SA	302	220.800	66,681.60	
	PKO BANK POLSKI SA	18,805	26.190	492,502.95	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	751	234.800	176,334.80	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	12,687	30.280	384,162.36	
	ORANGE POLSKA SA	15,737	6.008	94,547.89	
	PGE SA	19,508	10.340	201,712.72	
	CD PROJEKT SA	1,469	90.810	133,399.89	
CYFROWY POLSAT SA	5,742	19.980	114,725.16		
	ポーランド・ズロチ小計	134,215		3,926,361.23 (112,514,593)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	8,186	2,906.000	23,788,516.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,331	8,075.000	18,822,825.00	
	OTP BANK PLC	4,109	8,120.000	33,365,080.00	
	ハンガリー・フォリント小計	14,626		75,976,421.00 (25,518,275)	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	2,326	15.050	35,006.30	
	FF GROUP	123	4.800	590.40	

OPAP SA	3,519	13.540	47,647.26
JUMBO SA	2,111	15.150	31,981.65
ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	53,592	0.865	46,357.08
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	49,209	0.893	43,943.63
NATIONAL BANK OF GREECE	13,389	3.048	40,809.67
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,197	16.820	70,593.54
PUBLIC POWER CORP	4,579	5.765	26,397.93
ユーロ小計	133,045		343,327.46 (46,603,268)
合計	48,361,333		15,542,211,819 (15,542,211,819)

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 31銘柄	2.4%	3.5%
香港・ドル	株式 198銘柄	19.0%	27.7%
台湾・ドル	株式 87銘柄	11.8%	17.2%
エジプト・ポンド	株式 3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式 12銘柄	0.2%	0.3%
メキシコ・ペソ	株式 17銘柄	1.3%	1.9%
フィリピン・ペソ	株式 20銘柄	0.6%	0.9%
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.4%	0.6%
コロンビア・ペソ	株式 4銘柄	0.1%	0.2%
インド・ルピー	株式 109銘柄	11.1%	16.2%
インドネシア・ルピア	株式 25銘柄	1.5%	2.2%
ブラジル・リアル	株式 44銘柄	4.0%	5.9%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.1%	0.2%
韓国・ウォン	株式 112銘柄	9.5%	13.8%
マレーシア・リンギット	株式 34銘柄	1.2%	1.7%
南アフリカ・ランド	株式 36銘柄	2.8%	4.1%
タイ・バーツ	株式 42銘柄	1.5%	2.2%
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.5%	0.7%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.1%	0.2%
ユーロ	株式 9銘柄	0.2%	0.3%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オフショア・人民元	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	1,170,200.00	49,803,712.00	
		オフショア・人民元小計	1,170,200.00	49,803,712.00 (979,768,505)	
投資信託受益証券合計				979,768,505 (979,768,505)	
投資証券	アメリカ	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	30,716.00	1,144,324.58	

カ・ドル	ISHARES MSCI QATAR ETF	65,006.00	1,446,383.50	
	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	139,892.00	6,165,040.44	
	ISHARES MSCI UAE ETF	112,274.00	1,851,398.26	
アメリカ・ドル小計		347,888.00	10,607,146.78 (1,409,795,880)	
メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	317,700.00	2,614,671.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	11,025.00	1,360,705.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	41,800.00	5,309,854.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	54,100.00	1,738,774.00	
	TRUST FIBRA UNO	66,400.00	1,381,784.00	
メキシコ・ペソ小計		491,025.00	12,405,788.50 (80,910,553)	
ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	23,000.00	518,190.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	7,800.00	220,662.00	
	ENERGISA SA-UNITS	3,100.00	136,524.00	
	KLABIN SA - UNIT	17,500.00	348,775.00	
ブラジル・リアル小計		51,400.00	1,224,151.00 (31,443,298)	
南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	72,006.00	975,681.30	
	南アフリカ・ランド小計		72,006.00	975,681.30 (7,795,695)
投資証券合計			1,529,945,424 (1,529,945,424)	
合 計			2,509,713,929 (2,509,713,929)	

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

通貨	銘柄数		組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	4銘柄	-	6.2%	56.2%
メキシコ・ペソ	投資証券	5銘柄	-	0.4%	3.2%
ブラジル・リアル	投資証券	4銘柄	-	0.1%	1.3%
オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	4.3%	-	39.0%
南アフリカ・ランド	投資証券	1銘柄	-	0.0%	0.3%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2022年8月1日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	17,298,728
コール・ローン	513,036,157
国債証券	97,056,099,620
地方債証券	11,816,703,550
特殊債券	9,565,404,223
社債券	6,416,805,200
未収利息	227,205,023
前払費用	7,179,062
流動資産合計	125,619,731,563
資産合計	
	125,619,731,563
負債の部	
流動負債	
未払金	159,843,200
未払解約金	1,729,999
その他未払費用	1,770
流動負債合計	161,574,969
負債合計	
	161,574,969
純資産の部	
元本等	
元本	90,956,138,558
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	34,502,018,036
元本等合計	125,458,156,594
純資産合計	
	125,458,156,594
負債純資産合計	
	125,619,731,563

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

	<p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
--	--

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	90,956,138,558口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3793円 (1万口当たりの純資産額13,793円)

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年8月1日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2021年8月3日

至 2022年8月1日

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

（その他の注記）

（2022年8月1日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	85,708,688,826円
同期中における追加設定元本額	17,918,804,882円
同期中における一部解約元本額	12,671,355,150円
2022年8月1日現在の元本の内訳	
三井住友・日本債券インデックス・ファンド	54,174,627,983円
三井住友D S ・国内債券インデックス年金ファンド	761,253,427円
日興FWS・日本債インデックス	2,975,773,625円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	2,566,450,216円
国内債券インデックスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	36,764,129円
S M A M ・年金国内債券パッシブファンド < 適格機関投資家限定 >	30,441,269,178円
合 計	90,956,138,558円

（3）附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	4 3 4 2年国債	90,000,000	90,170,100	
	4 3 5 2年国債	5,940,000,000	5,951,345,400	
	4 3 8 2年国債	820,000,000	821,566,200	
	4 3 9 2年国債	100,000,000	100,190,000	
	1 3 9 5年国債	210,000,000	210,718,200	
	1 4 0 5年国債	640,000,000	642,412,800	
	1 4 1 5年国債	1,090,000,000	1,094,654,300	
	1 4 2 5年国債	530,000,000	532,464,500	
	1 4 3 5年国債	440,000,000	442,261,600	
	1 4 4 5年国債	1,220,000,000	1,226,868,600	
	1 4 5 5年国債	890,000,000	895,455,700	
	1 4 6 5年国債	1,280,000,000	1,288,243,200	
	1 4 7 5年国債	790,000,000	792,583,300	
	1 4 8 5年国債	820,000,000	822,714,200	
	1 4 9 5年国債	1,500,000,000	1,504,650,000	
	1 5 0 5年国債	1,270,000,000	1,273,340,100	
	1 5 1 5年国債	640,000,000	641,478,400	
	1 5 2 5年国債	250,000,000	251,622,500	
1 5 3 5年国債	300,000,000	300,438,000		

2	40年国債	132,000,000	164,102,400	
3	40年国債	150,000,000	186,943,500	
4	40年国債	215,000,000	267,365,400	
5	40年国債	222,000,000	265,165,680	
6	40年国債	220,000,000	256,792,800	
7	40年国債	263,000,000	294,160,240	
8	40年国債	285,000,000	296,625,150	
9	40年国債	471,000,000	361,652,640	
10	40年国債	438,000,000	395,216,160	
11	40年国債	345,000,000	300,432,900	
12	40年国債	360,000,000	280,868,400	
13	40年国債	440,000,000	341,558,800	
14	40年国債	485,000,000	402,404,500	
15	40年国債	120,000,000	108,456,000	
334	10年国債	345,000,000	349,554,000	
335	10年国債	95,000,000	96,218,850	
336	10年国債	115,000,000	116,634,150	
337	10年国債	305,000,000	307,876,150	
338	10年国債	607,000,000	614,921,350	
339	10年国債	615,000,000	623,794,500	
340	10年国債	883,000,000	896,739,480	
341	10年国債	365,000,000	369,828,950	
342	10年国債	900,000,000	906,057,000	
343	10年国債	577,000,000	581,039,000	
344	10年国債	1,150,000,000	1,158,096,000	
345	10年国債	725,000,000	729,937,250	
346	10年国債	460,000,000	463,091,200	
347	10年国債	105,000,000	105,641,550	
348	10年国債	305,000,000	306,799,500	
349	10年国債	305,000,000	306,805,600	
350	10年国債	305,000,000	306,802,550	
351	10年国債	90,000,000	90,502,200	
352	10年国債	615,000,000	618,388,650	
353	10年国債	600,000,000	603,060,000	
354	10年国債	600,000,000	602,976,000	
355	10年国債	840,000,000	843,746,400	
356	10年国債	1,005,000,000	1,008,929,550	
357	10年国債	1,210,000,000	1,212,662,000	
358	10年国債	1,180,000,000	1,181,781,800	
359	10年国債	1,060,000,000	1,060,413,400	
360	10年国債	1,470,000,000	1,469,397,300	
361	10年国債	1,200,000,000	1,198,500,000	
362	10年国債	1,080,000,000	1,077,688,800	
363	10年国債	910,000,000	907,197,200	
364	10年国債	750,000,000	747,292,500	

365	10年国債	1,150,000,000	1,145,204,500
366	10年国債	470,000,000	473,351,100
367	10年国債	910,000,000	911,765,400
2	30年国債	150,000,000	176,259,000
4	30年国債	160,000,000	196,883,200
5	30年国債	100,000,000	118,107,000
7	30年国債	180,000,000	216,946,800
10	30年国債	230,000,000	250,373,400
11	30年国債	150,000,000	172,950,000
12	30年国債	230,000,000	275,496,300
14	30年国債	220,000,000	271,917,800
15	30年国債	250,000,000	312,562,500
16	30年国債	175,000,000	219,304,750
18	30年国債	160,000,000	197,497,600
19	30年国債	150,000,000	185,482,500
21	30年国債	122,000,000	151,254,380
22	30年国債	149,000,000	188,954,350
23	30年国債	151,000,000	191,821,340
24	30年国債	135,000,000	171,661,950
25	30年国債	175,000,000	217,999,250
26	30年国債	219,000,000	276,102,060
27	30年国債	206,000,000	263,224,740
28	30年国債	251,000,000	321,445,660
29	30年国債	190,000,000	240,840,200
30	30年国債	270,000,000	338,382,900
31	30年国債	277,000,000	342,928,770
32	30年国債	377,000,000	473,146,310
33	30年国債	380,000,000	458,382,600
34	30年国債	379,000,000	469,596,160
35	30年国債	335,000,000	403,715,200
36	30年国債	315,000,000	380,097,900
37	30年国債	345,000,000	410,098,050
38	30年国債	385,000,000	450,380,700
39	30年国債	240,000,000	285,194,400
40	30年国債	240,000,000	280,596,000
41	30年国債	240,000,000	275,913,600
42	30年国債	250,000,000	287,250,000
43	30年国債	280,000,000	321,538,000
44	30年国債	317,000,000	363,805,050
45	30年国債	302,000,000	334,199,240
46	30年国債	315,000,000	348,241,950
47	30年国債	315,000,000	354,148,200
48	30年国債	335,000,000	362,557,100
49	30年国債	315,000,000	340,489,800
50	30年国債	410,000,000	391,332,700

5 1	3 0年国債	317,000,000	268,273,930	
5 2	3 0年国債	317,000,000	280,725,690	
5 3	3 0年国債	312,000,000	282,004,320	
5 4	3 0年国債	190,000,000	179,474,000	
5 5	3 0年国債	270,000,000	254,423,700	
5 6	3 0年国債	475,000,000	446,058,250	
5 7	3 0年国債	315,000,000	295,076,250	
5 8	3 0年国債	410,000,000	382,726,800	
5 9	3 0年国債	310,000,000	281,613,300	
6 0	3 0年国債	310,000,000	294,720,100	
6 1	3 0年国債	330,000,000	297,828,300	
6 2	3 0年国債	235,000,000	200,586,600	
6 3	3 0年国債	215,000,000	177,869,500	
6 4	3 0年国債	315,000,000	259,434,000	
6 5	3 0年国債	275,000,000	226,619,250	
6 6	3 0年国債	285,000,000	234,765,900	
6 7	3 0年国債	350,000,000	302,022,000	
6 8	3 0年国債	360,000,000	310,003,200	
6 9	3 0年国債	320,000,000	282,828,800	
7 0	3 0年国債	420,000,000	369,734,400	
7 1	3 0年国債	320,000,000	281,158,400	
7 2	3 0年国債	310,000,000	271,845,200	
7 3	3 0年国債	330,000,000	289,129,500	
7 4	3 0年国債	350,000,000	331,436,000	
7 5	3 0年国債	140,000,000	142,296,000	
6 9	2 0年国債	200,000,000	207,218,000	
7 0	2 0年国債	380,000,000	397,913,200	
7 2	2 0年国債	300,000,000	314,046,000	
7 4	2 0年国債	278,000,000	292,575,540	
7 5	2 0年国債	230,000,000	243,310,100	
7 8	2 0年国債	340,000,000	359,601,000	
8 2	2 0年国債	288,000,000	307,872,000	
8 4	2 0年国債	424,000,000	454,074,320	
8 5	2 0年国債	332,000,000	358,413,920	
8 8	2 0年国債	329,000,000	359,491,720	
9 0	2 0年国債	418,000,000	457,337,980	
9 2	2 0年国債	295,000,000	322,933,550	
9 3	2 0年国債	242,000,000	264,960,960	
9 5	2 0年国債	186,000,000	207,137,040	
9 7	2 0年国債	270,000,000	300,728,700	
9 9	2 0年国債	177,000,000	197,116,050	
1 0 0	2 0年国債	130,000,000	146,142,100	
1 0 2	2 0年国債	285,000,000	325,136,550	
1 0 5	2 0年国債	237,000,000	267,364,440	
1 0 7	2 0年国債	248,000,000	280,884,800	

109	20年国債	315,000,000	354,091,500	
111	20年国債	393,000,000	451,415,520	
113	20年国債	395,000,000	452,883,300	
114	20年国債	323,000,000	371,298,190	
116	20年国債	320,000,000	371,587,200	
118	20年国債	245,000,000	281,622,600	
119	20年国債	160,000,000	181,412,800	
121	20年国債	200,000,000	229,046,000	
122	20年国債	225,000,000	255,861,000	
123	20年国債	205,000,000	238,886,500	
124	20年国債	230,000,000	266,110,000	
125	20年国債	175,000,000	206,179,750	
126	20年国債	185,000,000	214,797,950	
127	20年国債	190,000,000	218,980,700	
129	20年国債	40,000,000	45,885,600	
130	20年国債	300,000,000	345,225,000	
131	20年国債	225,000,000	256,887,000	
132	20年国債	270,000,000	308,723,400	
133	20年国債	235,000,000	270,877,450	
134	20年国債	163,000,000	188,261,740	
135	20年国債	285,000,000	326,470,350	
136	20年国債	205,000,000	232,886,150	
137	20年国債	190,000,000	218,040,200	
139	20年国債	200,000,000	227,574,000	
140	20年国債	430,000,000	494,065,700	
141	20年国債	290,000,000	333,569,600	
142	20年国債	150,000,000	174,058,500	
143	20年国債	190,000,000	216,784,300	
144	20年国債	285,000,000	322,221,000	
145	20年国債	392,000,000	451,976,000	
146	20年国債	350,000,000	403,879,000	
147	20年国債	380,000,000	434,853,000	
148	20年国債	332,000,000	376,348,560	
149	20年国債	357,000,000	404,755,890	
150	20年国債	665,000,000	746,708,550	
151	20年国債	500,000,000	549,465,000	
152	20年国債	540,000,000	593,362,800	
153	20年国債	502,000,000	557,686,860	
154	20年国債	455,000,000	499,485,350	
155	20年国債	680,000,000	728,586,000	
156	20年国債	480,000,000	475,694,400	
157	20年国債	523,000,000	502,958,640	
158	20年国債	525,000,000	524,653,500	
159	20年国債	458,000,000	462,900,600	
160	20年国債	470,000,000	480,518,600	

	161	20年国債	515,000,000	517,827,350	
	162	20年国債	485,000,000	486,348,300	
	163	20年国債	535,000,000	535,374,500	
	164	20年国債	465,000,000	457,048,500	
	165	20年国債	485,000,000	475,552,200	
	166	20年国債	420,000,000	423,372,600	
	167	20年国債	465,000,000	452,993,700	
	168	20年国債	515,000,000	491,984,650	
	169	20年国債	415,000,000	388,469,050	
	170	20年国債	420,000,000	391,599,600	
	171	20年国債	425,000,000	394,676,250	
	172	20年国債	390,000,000	367,313,700	
	173	20年国債	500,000,000	469,445,000	
	174	20年国債	525,000,000	491,352,750	
	175	20年国債	480,000,000	455,822,400	
	176	20年国債	520,000,000	491,914,800	
	177	20年国債	500,000,000	463,010,000	
	178	20年国債	480,000,000	451,608,000	
	179	20年国債	460,000,000	431,769,800	
	180	20年国債	570,000,000	564,727,500	
	181	20年国債	110,000,000	110,746,900	
		国債証券 小計		97,056,099,620	
地方債証券	792	東京都公債	300,000,000	297,954,000	
	793	東京都公債	200,000,000	198,434,200	
	8	東京都30年	100,000,000	123,029,400	
	13	東京都30年	200,000,000	237,175,800	
	1	東京都20年	200,000,000	202,793,600	
	6	東京都20年	400,000,000	420,675,600	
	7	東京都20年	100,000,000	106,669,600	
	11	東京都20年	100,000,000	109,983,500	
	26-13	北海道公債	100,000,000	101,010,500	
	29-5	北海道公債	100,000,000	100,379,200	
	30-18	北海道公債	200,000,000	199,586,400	
	233	神奈川県公債	100,000,000	100,502,600	
	7	神奈川県20年	200,000,000	219,946,600	
	78	神奈川県5年	100,000,000	99,941,600	
	395	大阪府公債	200,000,000	202,184,000	
	397	大阪府公債	100,000,000	101,540,500	
	407	大阪府公債	100,000,000	100,163,700	
	425	大阪府公債	200,000,000	200,822,400	
	147	大阪府5年	100,000,000	100,009,700	
	170	大阪府5年	100,000,000	99,904,200	
	27-11	京都府公債	200,000,000	202,918,000	
	30-6	京都府5年	200,000,000	200,138,600	
	30-12	京都府5年	300,000,000	300,000,000	

1	兵庫県公債 1 5 年	200,000,000	212,794,000	
3	兵庫県公債 1 2 年	100,000,000	101,411,500	
5	兵庫県公債 1 5 年	100,000,000	106,761,300	
9	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	114,738,300	
2 6 - 1 0	静岡県公債	100,000,000	101,115,300	
7	静岡県 3 0 年	100,000,000	119,114,200	
1	静岡県 2 0 年	100,000,000	106,742,300	
2 6 - 1 4	愛知県公債	100,000,000	101,166,000	
2 6 - 1 8	愛知県公債	100,000,000	101,081,100	
2 7 - 1 6	愛知県公債	200,000,000	202,819,600	
2 9 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	100,860,300	
2 6 - 1	広島県公債	100,000,000	101,165,400	
3 0 - 2	広島県公債	200,000,000	200,593,400	
2 4 - 9	埼玉県公債	100,000,000	100,432,700	
2 6 - 4	埼玉県公債	100,000,000	101,176,100	
6	埼玉県 2 0 年	100,000,000	113,008,400	
1 3	埼玉県 2 0 年	100,000,000	112,697,600	
2 5 - 1 1	福岡県公債	100,000,000	101,065,900	
2 6 - 5	福岡県公債	200,000,000	202,203,600	
3 0 - 6	福岡県公債	100,000,000	100,348,100	
3 0 - 7	福岡県 5 年	100,000,000	100,020,600	
1 - 3	福岡県 3 0 年	100,000,000	81,436,200	
2 6 - 3	千葉県公債	300,000,000	303,408,300	
2 6 - 5	千葉県公債	200,000,000	202,119,800	
1 - 2	千葉県 5 年	100,000,000	99,960,100	
1 1	群馬県公債	100,000,000	101,085,200	
1 3 7	共同発行地方	100,000,000	101,086,900	
1 3 8	共同発行地方	100,000,000	101,117,900	
1 4 0	共同発行地方	100,000,000	101,085,200	
1 4 9	共同発行地方	100,000,000	101,442,600	
1 5 4	共同発行地方	150,000,000	151,911,750	
1 7 5	共同発行地方	200,000,000	201,282,000	
1 7 6	共同発行地方	100,000,000	100,462,300	
1 7 9	共同発行地方	100,000,000	100,757,600	
1 8 3	共同発行地方	600,000,000	602,673,600	
1 8 5	共同発行地方	200,000,000	201,367,200	
1 - 1	大阪市 5 年	400,000,000	399,841,200	
4 8 2	名古屋市債	200,000,000	200,848,200	
4 8 7	名古屋市債	300,000,000	303,526,200	
4 9 4	名古屋市債	200,000,000	202,879,000	
2 6 - 3	横浜市公債	300,000,000	303,292,800	
9	横浜市 2 0 年	100,000,000	108,932,800	
1 6	横浜市 2 0 年	100,000,000	113,563,700	
9 1	川崎市公債	100,000,000	100,322,600	
1 - 2	北九州市 5 年	100,000,000	99,921,000	

	26 - 5 福岡市公債	200,000,000	202,261,600	
	27 - 5 福岡市公債	100,000,000	101,437,200	
	29 - 1 1 福岡市5年	300,000,000	300,117,300	
	27 - 1 三重県公債	100,000,000	101,447,200	
	30 - 2 岡山県公債	100,000,000	100,036,700	
	地方債証券 小計		11,816,703,550	
特殊債券	22 政保政策投資B	100,000,000	102,030,800	
	66 日本政策投資CO	100,000,000	99,982,900	
	42 政保政策投資C	100,000,000	100,618,100	
	60 政保政策投資C	100,000,000	100,017,900	
	4 道路機構	100,000,000	125,576,200	
	22 道路機構	200,000,000	261,959,000	
	27 道路機構	100,000,000	111,297,400	
	37 道路機構	700,000,000	791,077,700	
	104 道路機構	400,000,000	401,776,800	
	122 道路機構	200,000,000	202,110,600	
	79 政保道路機構	100,000,000	113,528,100	
	92 政保道路機構	100,000,000	114,363,800	
	99 政保道路機構	100,000,000	115,480,800	
	185 政保道路機構	100,000,000	115,160,100	
	207 政保道路機構	200,000,000	202,165,200	
	209 政保道路機構	100,000,000	101,221,800	
	210 政保道路機構	400,000,000	453,037,600	
	220 政保道路機構	300,000,000	303,939,000	
	221 政保道路機構	100,000,000	112,382,900	
	227 政保道路機構	300,000,000	303,857,700	
	246 政保道路機構	100,000,000	108,911,000	
	333 政保道路機構	100,000,000	100,617,800	
	339 政保道路機構	100,000,000	100,868,200	
	354 政保道路機構	200,000,000	200,828,200	
	27 道路債券	100,000,000	103,851,500	
	32 道路債券	100,000,000	105,052,600	
	42 道路債券	100,000,000	105,636,600	
	59 地方公共団体	100,000,000	101,136,300	
	61 地方公共団体	100,000,000	101,165,200	
	62 地方公共団体	300,000,000	303,261,600	
	F281 地方公共団体	100,000,000	105,455,700	
	48 地方公共団20	100,000,000	106,658,700	
	102 地方公共団体	100,000,000	100,155,000	
	106 地方公共団体	300,000,000	300,624,600	
	4 公営企業20年	200,000,000	204,706,000	
	16 公営企業20年	100,000,000	106,783,900	
	18 公営企業20年	100,000,000	109,603,300	
	22 公営企業20年	200,000,000	221,100,000	
	6 福祉医療機構	100,000,000	105,339,000	

1 1 7	住宅支援機構	100,000,000	106,522,300	
1 3 0	住宅支援機構	100,000,000	113,672,300	
1 9 0	住宅支援機構	100,000,000	99,922,600	
2 2 2	住宅支援機構	200,000,000	200,428,600	
2 2 6	住宅支援機構	200,000,000	200,715,000	
S 9	住宅金融R M B S	10,008,000	10,044,028	
S 1 0	住宅金融R M B S	10,278,000	10,311,917	
S 1	住宅機構R M B S	10,432,000	10,546,752	
S 3	住宅機構R M B S	10,805,000	10,931,418	
3 2	住宅金融R M B S	10,786,000	10,879,838	
3 5	住宅金融R M B S	11,521,000	11,699,575	
3 7	住宅金融R M B S	10,878,000	11,050,960	
4 0	住宅金融R M B S	11,970,000	12,260,871	
4 2	住宅金融R M B S	10,061,000	10,097,219	
4 8	住宅金融R M B S	10,404,000	10,537,171	
2	住宅機構R M B S	11,328,000	11,564,755	
2 9	住宅機構R M B S	21,359,000	22,691,801	
3 2	住宅機構R M B S	20,944,000	22,104,297	
3 7	住宅機構R M B S	21,184,000	22,270,739	
4 9	住宅機構R M B S	19,726,000	20,672,848	
5 1	住宅機構R M B S	21,808,000	22,850,422	
5 5	住宅機構R M B S	28,787,000	30,139,989	
5 7	住宅機構R M B S	27,824,000	29,123,380	
5 9	住宅機構R M B S	29,536,000	30,959,635	
6 7	住宅機構R M B S	38,386,000	39,767,896	
6 9	住宅機構R M B S	39,390,000	41,142,855	
7 0	住宅機構R M B S	34,421,000	35,852,913	
7 3	住宅機構R M B S	39,320,000	41,105,128	
8 8	住宅機構R M B S	43,122,000	44,355,289	
1 1 3	住宅機構R M B S	74,321,000	73,637,246	
1 2 3	住宅機構R M B S	77,446,000	76,888,388	
1 2 4	住宅機構R M B S	77,388,000	76,590,903	
1 2 5	住宅機構R M B S	77,303,000	76,506,779	
1 3 2	住宅機構R M B S	79,633,000	78,589,807	
1 3 8	住宅機構R M B S	81,995,000	81,347,239	
1 4 6	住宅機構R M B S	86,716,000	83,967,102	
1 5 1	住宅機構R M B S	89,285,000	86,767,163	
1 5 7	住宅機構R M B S	90,605,000	88,539,206	
1 6 0	住宅機構R M B S	92,462,000	90,548,036	
1 6 6	住宅機構R M B S	188,882,000	186,067,658	
1 8 3	住宅機構R M B S	200,000,000	198,420,000	
3 5 0	信金中金	100,000,000	100,110,000	
8 5	中日本高速道	100,000,000	99,862,600	
	特殊債券 小計		9,565,404,223	
社債券	2 BPCE S.A.	100,000,000	99,940,800	

8 6	東日本高速道	200,000,000	199,042,400	
9 0	中日本高速道	300,000,000	298,988,700	
5 0	西日本高速道	100,000,000	99,872,000	
1 3	大和ハウス	100,000,000	100,115,000	
1 7	アサヒグループHD	100,000,000	100,134,100	
9	サントリーホールディング	100,000,000	100,171,000	
3 0	東レ	100,000,000	100,403,000	
5 6	住友化学	100,000,000	99,743,100	
2 4	三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	99,677,900	
1 1	ブリヂストン	200,000,000	200,151,800	
7	ジェイテクト	100,000,000	99,629,900	
9	T D K	100,000,000	98,744,700	
1	明治安田2 0 1 9基	200,000,000	199,404,400	
5 1	住友商事	100,000,000	105,115,900	
5 7	東京三菱銀行	100,000,000	100,522,200	
1	三井住友F G劣後	100,000,000	100,937,400	
1	みずほF G劣後	100,000,000	100,887,300	
1 7	NTTファイナンス	200,000,000	199,756,200	
7 3	ホンダファイナンス	200,000,000	199,122,600	
2 0 7	オリックス	200,000,000	198,699,000	
2	三菱HCキャピタル	200,000,000	197,790,200	
1	野村ホールディングス	100,000,000	100,020,700	
6 5	三菱地所	100,000,000	114,832,200	
1 3 5	三菱地所	200,000,000	196,451,400	
1 1	東急	100,000,000	99,745,200	
3 8	京王電鉄	100,000,000	100,232,400	
1 2 6	東日本旅客鉄	200,000,000	200,228,200	
1 6 3	東日本旅客鉄	300,000,000	298,702,200	
1 3	西日本旅客鉄	100,000,000	109,676,100	
3 2	東海旅客鉄道	100,000,000	110,542,900	
5 2	東海旅客鉄道	100,000,000	113,343,000	
4 5	東京地下鉄	200,000,000	196,931,000	
6 4	阪急阪神H L D G	100,000,000	99,512,500	
5 4 6	中部電力	200,000,000	193,021,800	
5 5 3	中部電力	100,000,000	99,255,500	
5 5 0	関西電力	300,000,000	299,003,700	
5 0 8	東北電力	200,000,000	198,715,800	
5 4 7	東北電力	100,000,000	99,528,700	
4 9 6	九州電力	200,000,000	193,604,200	
3 8	東京電力パワー	100,000,000	100,186,300	
4 1	大阪瓦斯	300,000,000	294,057,300	
7	ファーストリテイリング	100,000,000	100,364,500	
	社債券 小計		6,416,805,200	
	合 計		124,855,012,593	

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。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2022年8月1日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	28,392,965
金銭信託	10,909,747
コール・ローン	323,555,263
国債証券	23,199,395,040
派生商品評価勘定	1,348,727
未収入金	902,767,956
未収利息	130,969,243
前払費用	16,896,176
流動資産合計	24,614,235,117
資産合計	24,614,235,117
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	74,627,506
未払金	383,889,300
未払解約金	18,000,000
その他未払費用	473
流動負債合計	476,517,279
負債合計	476,517,279
純資産の部	
元本等	
元本	17,665,246,854
剰余金	
剰余金又は欠損金()	6,472,470,984
元本等合計	24,137,717,838
純資産合計	24,137,717,838
負債純資産合計	24,614,235,117

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	17,665,246,854口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3664円 (1万口当たりの純資産額13,664円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p>

	<p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券)</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益	
			うち 1年超			
市場取引以 外の取引	為替予約取引					
	買建					
	アメリカ・ドル	195,312,472	-	196,036,190	723,718	
	カナダ・ドル	15,534,339	-	15,594,652	60,313	
	オーストラリア・ド ル	3,268,636	-	3,282,086	13,450	
	シンガポール・ドル	6,905,983	-	6,928,534	22,551	
	イギリス・ポンド	22,596,462	-	22,664,906	68,444	
	デンマーク・クロー ネ	659,016	-	660,465	1,449	
	メキシコ・ペソ	1,790,394	-	1,804,401	14,007	
	オフショア・人民元	60,946,923	-	61,215,497	268,574	
	ポーランド・ズロチ	1,047,544	-	1,050,504	2,960	
	ユーロ	75,692,891	-	75,866,152	173,261	
	小計	383,754,660	-	385,103,387	1,348,727	
	売建					
	アメリカ・ドル	11,835,886,428	-	11,878,663,280	42,776,852	
	カナダ・ドル	496,798,942	-	498,704,192	1,905,250	
	オーストラリア・ド ル	363,421,305	-	364,932,650	1,511,345	
	シンガポール・ドル	225,774,772	-	226,524,909	750,137	
	イギリス・ポンド	1,194,129,603	-	1,197,743,747	3,614,144	
	イスラエル・シュケ ル	91,787,730	-	92,588,553	800,823	
	デンマーク・クロー ネ	88,656,989	-	88,858,108	201,119	
	ノルウェー・クロー ネ	48,481,746	-	48,615,120	133,374	
	スウェーデン・ク ローナ	61,718,971	-	61,839,462	120,491	
	メキシコ・ペソ	178,761,513	-	179,954,248	1,192,735	
	オフショア・人民元	585,589,891	-	588,021,924	2,432,033	
	ポーランド・ズロチ	98,681,369	-	98,910,935	229,566	
	ユーロ	8,128,252,297	-	8,147,211,934	18,959,637	
	小計	23,397,941,556	-	23,472,569,062	74,627,506	
	合 計		23,781,696,216	-	23,857,672,449	73,278,779

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年8月1日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	15,468,389,590円
同期中における追加設定元本額	10,049,366,018円
同期中における一部解約元本額	7,852,508,754円
2022年8月1日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,630,472,647円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,288,767,287円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	388,418,954円
イオン・バランス戦略ファンド	1,039,857,753円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,163,020,079円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	815,825,160円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,446,803,280円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	357,947,595円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	94,452,387円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	53,253,472円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	510,667,685円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,156,400,611円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	885,316円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	4,475,421,788円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	363,835,881円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	385,698,151円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	493,518,808円
合計	17,665,246,854円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリ カ・ドル	T 0.125 01/15/24	600,000.00	575,856.00	
		T 0.125 02/15/24	1,050,000.00	1,005,700.50	
		T 0.125 08/15/23	750,000.00	728,407.50	
		T 0.125 09/15/23	570,000.00	552,318.60	
		T 0.125 10/15/23	1,090,000.00	1,054,487.80	
		T 0.25 03/15/24	890,000.00	852,175.00	
		T 0.25 05/15/24	530,000.00	505,445.10	
		T 0.25 05/31/25	370,000.00	344,026.00	
		T 0.25 06/15/24	620,000.00	589,967.20	
		T 0.25 06/30/25	650,000.00	603,174.00	
		T 0.25 08/31/25	590,000.00	545,171.80	
		T 0.25 09/30/25	290,000.00	267,525.00	
		T 0.25 10/31/25	420,000.00	386,744.40	
		T 0.25 11/15/23	500,000.00	483,045.00	
		T 0.375 01/31/26	330,000.00	303,573.60	
		T 0.375 04/30/25	320,000.00	299,123.20	
		T 0.375 07/31/27	170,000.00	151,590.70	
		T 0.375 08/15/24	410,000.00	389,594.30	
		T 0.375 09/15/24	700,000.00	663,901.00	
		T 0.375 11/30/25	350,000.00	323,106.00	
		T 0.375 12/31/25	620,000.00	571,075.80	
		T 0.5 02/28/26	940,000.00	867,403.80	
		T 0.5 03/31/25	420,000.00	394,699.20	
		T 0.5 04/30/27	480,000.00	432,748.80	
		T 0.5 05/31/27	370,000.00	333,099.90	
		T 0.5 06/30/27	710,000.00	637,856.90	
		T 0.5 08/31/27	640,000.00	572,972.80	
		T 0.5 10/31/27	780,000.00	695,260.80	
		T 0.5 11/30/23	200,000.00	193,624.00	
		T 0.625 03/31/27	520,000.00	472,586.40	
		T 0.625 05/15/30	870,000.00	747,077.70	
		T 0.625 07/31/26	720,000.00	662,004.00	
T 0.625 08/15/30	790,000.00	675,631.70			
T 0.625 10/15/24	230,000.00	218,992.20			
T 0.625 11/30/27	580,000.00	519,552.40			

T 0.625 12/31/27	350,000.00	312,973.50	
T 0.75 01/31/28	710,000.00	638,055.70	
T 0.75 03/31/26	720,000.00	668,923.20	
T 0.75 08/31/26	160,000.00	147,686.40	
T 0.75 11/15/24	660,000.00	628,953.60	
T 0.75 12/31/23	980,000.00	949,982.60	
T 0.875 01/31/24	900,000.00	872,505.00	
T 0.875 06/30/26	500,000.00	464,880.00	
T 0.875 09/30/26	340,000.00	315,003.20	
T 0.875 11/15/30	1,100,000.00	958,716.00	
T 1 07/31/28	500,000.00	452,300.00	
T 1 12/15/24	600,000.00	574,404.00	
T 1.125 01/15/25	660,000.00	632,794.80	
T 1.125 02/15/31	910,000.00	807,333.80	
T 1.125 02/28/27	280,000.00	260,694.00	
T 1.125 02/29/28	270,000.00	247,617.00	
T 1.125 05/15/40	270,000.00	194,715.90	
T 1.125 08/15/40	380,000.00	272,349.80	
T 1.125 08/31/28	490,000.00	446,512.50	
T 1.125 10/31/26	240,000.00	224,426.40	
T 1.25 03/31/28	660,000.00	608,487.00	
T 1.25 04/30/28	730,000.00	672,220.50	
T 1.25 05/15/50	530,000.00	350,875.90	
T 1.25 05/31/28	580,000.00	533,460.80	
T 1.25 06/30/28	480,000.00	441,336.00	
T 1.25 08/15/31	990,000.00	880,862.40	
T 1.25 08/31/24	450,000.00	435,127.50	
T 1.25 09/30/28	560,000.00	513,665.60	
T 1.25 11/30/26	400,000.00	375,888.00	
T 1.25 12/31/26	730,000.00	685,199.90	
T 1.375 01/31/25	430,000.00	414,644.70	
T 1.375 08/15/50	680,000.00	465,426.00	
T 1.375 08/31/23	300,000.00	294,996.00	
T 1.375 08/31/26	470,000.00	445,174.60	
T 1.375 10/31/28	180,000.00	166,120.20	
T 1.375 11/15/31	1,010,000.00	905,606.40	
T 1.375 11/15/40	530,000.00	395,093.80	
T 1.375 12/31/28	720,000.00	664,761.60	
T 1.5 01/31/27	350,000.00	331,912.00	
T 1.5 02/15/30	300,000.00	276,936.00	
T 1.5 08/15/26	550,000.00	523,380.00	
T 1.5 11/30/24	510,000.00	494,220.60	
T 1.5 11/30/28	680,000.00	631,862.80	
T 1.625 02/15/26	600,000.00	576,510.00	

T 1.625 05/15/26	570,000.00	546,396.30	
T 1.625 05/15/31	930,000.00	857,739.00	
T 1.625 08/15/29	420,000.00	392,796.60	
T 1.625 09/30/26	480,000.00	459,110.40	
T 1.625 10/31/23	750,000.00	738,045.00	
T 1.625 11/15/50	610,000.00	445,580.60	
T 1.625 11/30/26	650,000.00	620,542.00	
T 1.75 01/31/29	400,000.00	377,592.00	
T 1.75 08/15/41	640,000.00	504,697.60	
T 1.75 11/15/29	330,000.00	311,153.70	
T 1.75 12/31/24	390,000.00	379,883.40	
T 1.75 12/31/26	300,000.00	288,009.00	
T 1.875 02/15/32	980,000.00	916,829.20	
T 1.875 02/15/41	410,000.00	332,801.10	
T 1.875 02/15/51	730,000.00	568,713.80	
T 1.875 02/28/27	200,000.00	192,820.00	
T 1.875 02/28/29	850,000.00	808,953.50	
T 1.875 06/30/26	750,000.00	725,647.50	
T 1.875 08/31/24	300,000.00	293,694.00	
T 1.875 11/15/51	670,000.00	522,600.00	
T 2 02/15/25	660,000.00	646,153.20	
T 2 02/15/50	470,000.00	378,237.20	
T 2 04/30/24	200,000.00	196,828.00	
T 2 05/31/24	500,000.00	491,910.00	
T 2 06/30/24	600,000.00	590,154.00	
T 2 08/15/25	600,000.00	585,468.00	
T 2 08/15/51	630,000.00	505,278.90	
T 2 11/15/41	590,000.00	486,195.40	
T 2.125 03/31/24	280,000.00	276,236.80	
T 2.125 05/31/26	320,000.00	312,860.80	
T 2.125 07/31/24	410,000.00	403,850.00	
T 2.25 01/31/24	460,000.00	455,183.80	
T 2.25 02/15/27	450,000.00	440,401.50	
T 2.25 02/15/52	400,000.00	341,700.00	
T 2.25 03/31/26	420,000.00	412,238.40	
T 2.25 04/30/24	420,000.00	415,174.20	
T 2.25 05/15/41	740,000.00	639,256.40	
T 2.25 08/15/27	570,000.00	557,237.70	
T 2.25 08/15/46	250,000.00	208,337.50	
T 2.25 08/15/49	460,000.00	391,358.80	
T 2.25 10/31/24	580,000.00	572,384.60	
T 2.25 11/15/24	500,000.00	493,085.00	
T 2.25 11/15/27	300,000.00	292,908.00	
T 2.25 12/31/23	550,000.00	544,538.50	

T 2.25 12/31/24	500,000.00	492,750.00	
T 2.375 02/15/42	530,000.00	465,652.70	
T 2.375 03/31/29	290,000.00	284,084.00	
T 2.375 04/30/26	400,000.00	394,592.00	
T 2.375 05/15/27	300,000.00	295,170.00	
T 2.375 05/15/29	600,000.00	588,606.00	
T 2.375 05/15/51	500,000.00	437,850.00	
T 2.375 08/15/24	270,000.00	267,129.90	
T 2.375 11/15/49	240,000.00	210,036.00	
T 2.5 01/31/24	450,000.00	446,904.00	
T 2.5 01/31/25	400,000.00	396,528.00	
T 2.5 02/15/45	220,000.00	192,775.00	
T 2.5 02/15/46	150,000.00	131,496.00	
T 2.5 03/31/27	310,000.00	307,092.20	
T 2.5 05/15/24	900,000.00	893,457.00	
T 2.5 05/15/46	230,000.00	201,572.00	
T 2.5 08/15/23	300,000.00	298,581.00	
T 2.625 01/31/26	430,000.00	427,914.50	
T 2.625 02/15/29	520,000.00	518,008.40	
T 2.625 03/31/25	500,000.00	497,225.00	
T 2.75 02/15/28	420,000.00	420,525.00	
T 2.75 02/28/25	500,000.00	498,535.00	
T 2.75 04/30/27	290,000.00	290,452.40	
T 2.75 05/15/25	320,000.00	319,084.80	
T 2.75 05/31/29	430,000.00	431,358.80	
T 2.75 06/30/25	320,000.00	319,299.20	
T 2.75 08/15/47	210,000.00	193,739.70	
T 2.75 08/31/25	600,000.00	598,500.00	
T 2.75 11/15/23	900,000.00	897,885.00	
T 2.75 11/15/42	440,000.00	407,580.80	
T 2.75 11/15/47	250,000.00	231,052.50	
T 2.875 04/30/25	200,000.00	200,030.00	
T 2.875 05/15/28	500,000.00	503,905.00	
T 2.875 05/15/32	750,000.00	765,052.50	
T 2.875 05/15/43	290,000.00	273,594.70	
T 2.875 05/15/49	410,000.00	395,678.70	
T 2.875 05/15/52	360,000.00	352,854.00	
T 2.875 05/31/25	600,000.00	600,300.00	
T 2.875 08/15/28	660,000.00	665,511.00	
T 2.875 08/15/45	110,000.00	103,141.50	
T 2.875 11/15/46	340,000.00	319,732.60	
T 2.875 11/30/23	900,000.00	898,731.00	
T 2.875 11/30/25	390,000.00	391,248.00	
T 3 02/15/47	120,000.00	115,593.60	

T 3 02/15/48	400,000.00	389,124.00	
T 3 02/15/49	370,000.00	364,968.00	
T 3 05/15/42	290,000.00	281,865.50	
T 3 05/15/45	290,000.00	277,559.00	
T 3 05/15/47	300,000.00	289,335.00	
T 3 06/30/24	150,000.00	150,246.00	
T 3 08/15/48	350,000.00	341,876.50	
T 3 09/30/25	620,000.00	623,509.20	
T 3 11/15/44	220,000.00	210,665.40	
T 3 11/15/45	300,000.00	288,021.00	
T 3.125 02/15/42	150,000.00	148,815.00	
T 3.125 02/15/43	190,000.00	186,540.10	
T 3.125 05/15/48	420,000.00	419,701.80	
T 3.125 08/15/44	110,000.00	107,559.10	
T 3.125 11/15/28	380,000.00	388,964.20	
T 3.125 11/15/41	210,000.00	208,998.30	
T 3.375 05/15/44	300,000.00	305,952.00	
T 3.375 11/15/48	450,000.00	472,918.50	
T 3.5 02/15/39	180,000.00	196,200.00	
T 3.625 02/15/44	50,000.00	52,964.50	
T 3.625 08/15/43	230,000.00	244,032.30	
T 3.875 08/15/40	120,000.00	134,587.20	
T 4.25 05/15/39	170,000.00	201,781.50	
T 4.25 11/15/40	140,000.00	164,269.00	
T 4.375 02/15/38	40,000.00	48,465.60	
T 4.375 05/15/40	140,000.00	167,825.00	
T 4.375 05/15/41	120,000.00	142,752.00	
T 4.375 11/15/39	150,000.00	180,210.00	
T 4.5 02/15/36	100,000.00	121,828.00	
T 4.5 08/15/39	120,000.00	146,680.80	
T 4.625 02/15/40	100,000.00	123,804.00	
T 5.25 11/15/28	200,000.00	229,202.00	
T 5.375 02/15/31	80,000.00	96,543.20	
US TREASURY N/B	630,000.00	603,269.10	
US TREASURY N/B	520,000.00	495,258.40	
アメリカ・ドル小計	94,170,000.00	88,441,796.90 (11,754,799,226)	
カナダ・ドル	CAN 0.25 03/01/26	270,000.00	247,438.80
	CAN 0.25 04/01/24	460,000.00	440,118.80
	CAN 0.25 08/01/23	150,000.00	145,821.00
	CAN 0.5 09/01/25	270,000.00	251,607.60
	CAN 0.5 12/01/30	320,000.00	269,676.80
	CAN 1 06/01/27	140,000.00	129,950.80
	CAN 1.25 03/01/25	250,000.00	239,970.00

	CAN 1.25 03/01/27	120,000.00	112,965.60	
	CAN 1.25 06/01/30	440,000.00	398,310.00	
	CAN 1.5 06/01/26	170,000.00	162,679.80	
	CAN 1.5 06/01/31	260,000.00	237,276.00	
	CAN 1.5 09/01/24	150,000.00	145,771.50	
	CAN 1.5 12/01/31	290,000.00	263,563.60	
	CAN 1.75 12/01/53	210,000.00	165,454.80	
	CAN 2 06/01/28	60,000.00	58,112.40	
	CAN 2 09/01/23	80,000.00	79,048.00	
	CAN 2 12/01/51	280,000.00	236,588.80	
	CAN 2.25 03/01/24	140,000.00	138,495.00	
	CAN 2.25 06/01/25	130,000.00	128,001.90	
	CAN 2.25 06/01/29	150,000.00	147,019.50	
	CAN 2.5 06/01/24	160,000.00	158,798.40	
	CAN 2.75 12/01/48	140,000.00	139,109.60	
	CAN 3.5 12/01/45	90,000.00	100,745.10	
	CAN 4 06/01/41	90,000.00	105,510.60	
	CAN 5 06/01/37	100,000.00	126,683.00	
	CAN 5.75 06/01/29	90,000.00	107,748.90	
	CAN 5.75 06/01/33	10,000.00	12,860.70	
	CANADA 2.75 12/01/64	50,000.00	49,616.00	
	カナダ・ドル小計	5,070,000.00	4,798,943.00 (497,890,336)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/24	240,000.00	227,726.40	
	ACGB 0.25 11/21/25	140,000.00	129,105.20	
	ACGB 0.5 09/21/26	170,000.00	155,021.30	
	ACGB 1 11/21/31	250,000.00	208,802.50	
	ACGB 1 12/21/30	260,000.00	221,234.00	
	ACGB 1.25 05/21/32	170,000.00	144,149.80	
	ACGB 1.5 06/21/31	220,000.00	193,837.60	
	ACGB 1.75 06/21/51	150,000.00	104,143.50	
	ACGB 1.75 11/21/32	200,000.00	176,712.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	190,000.00	183,842.10	
	ACGB 2.5 05/21/30	200,000.00	193,356.00	
	ACGB 2.75 04/21/24	130,000.00	130,669.50	
	ACGB 2.75 05/21/41	130,000.00	117,835.90	
	ACGB 2.75 06/21/35	110,000.00	104,875.10	
	ACGB 2.75 11/21/27	320,000.00	318,832.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	110,000.00	109,133.20	
	ACGB 2.75 11/21/29	180,000.00	177,606.00	
	ACGB 3 03/21/47	110,000.00	102,019.50	
	ACGB 3.25 04/21/25	180,000.00	182,763.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	130,000.00	132,641.60	
ACGB 3.25 06/21/39	100,000.00	98,543.00		

	ACGB 3.75 04/21/37	120,000.00	126,661.20	
	ACGB 4.25 04/21/26	170,000.00	179,028.70	
	ACGB 4.5 04/21/33	180,000.00	203,216.40	
	オーストラリア・ドル小計	4,160,000.00	3,921,755.50 (363,978,128)	
シンガ ポール・ ドル	SIGB 1.875 03/01/50	120,000.00	97,560.00	
	SIGB 2 02/01/24	120,000.00	119,004.00	
	SIGB 2.125 06/01/26	500,000.00	492,650.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	160,000.00	150,755.20	
	SIGB 2.375 07/01/39	100,000.00	94,900.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	230,000.00	230,425.50	
	SIGB 2.75 03/01/46	120,000.00	117,480.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	100,000.00	98,611.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	170,000.00	172,813.50	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	203,734.00	
	SIGB 3 09/01/24	230,000.00	232,118.30	
	SIGB 3.375 09/01/33	220,000.00	234,876.40	
	シンガポール・ドル小計	2,270,000.00	2,244,927.90 (215,984,513)	
イギリ ス・ポン ド	UK TSY GILT	190,000.00	157,869.10	
	UKT 0.125 01/30/26	130,000.00	123,576.70	
	UKT 0.125 01/31/24	290,000.00	282,384.60	
	UKT 0.125 01/31/28	90,000.00	83,100.60	
	UKT 0.25 01/31/25	160,000.00	154,054.40	
	UKT 0.25 07/31/31	200,000.00	173,674.00	
	UKT 0.375 10/22/26	100,000.00	94,638.00	
	UKT 0.375 10/22/30	110,000.00	98,532.50	
	UKT 0.5 01/31/29	110,000.00	101,822.60	
	UKT 0.5 10/22/61	140,000.00	76,659.80	
	UKT 0.625 06/07/25	130,000.00	126,478.30	
	UKT 0.625 07/31/35	140,000.00	114,437.40	
	UKT 0.625 10/22/50	80,000.00	51,219.20	
	UKT 0.875 01/31/46	110,000.00	79,274.80	
	UKT 0.875 07/31/33	120,000.00	106,452.00	
	UKT 0.875 10/22/29	100,000.00	94,609.00	
	UKT 1 01/31/32	150,000.00	138,085.50	
	UKT 1 04/22/24	90,000.00	88,927.20	
	UKT 1.125 10/22/73	90,000.00	60,406.20	
	UKT 1.25 07/22/27	100,000.00	98,380.00	
	UKT 1.25 07/31/51	90,000.00	68,408.10	
	UKT 1.25 10/22/41	200,000.00	164,350.00	
UKT 1.5 07/22/26	180,000.00	178,975.80		
UKT 1.5 07/22/47	150,000.00	123,256.50		
UKT 1.5 07/31/53	90,000.00	72,818.10		

UKT 1.625 10/22/28	110,000.00	110,294.80	
UKT 1.625 10/22/54	100,000.00	83,497.00	
UKT 1.625 10/22/71	100,000.00	81,842.00	
UKT 1.75 01/22/49	110,000.00	95,585.60	
UKT 1.75 07/22/57	140,000.00	120,758.40	
UKT 1.75 09/07/37	180,000.00	166,960.80	
UKT 2 09/07/25	110,000.00	111,133.00	
UKT 2.25 09/07/23	120,000.00	120,612.00	
UKT 2.5 07/22/65	140,000.00	148,961.40	
UKT 2.75 09/07/24	190,000.00	194,035.60	
UKT 3.25 01/22/44	180,000.00	202,968.00	
UKT 3.5 01/22/45	150,000.00	176,031.00	
UKT 3.5 07/22/68	120,000.00	161,526.00	
UKT 3.75 07/22/52	140,000.00	180,506.20	
UKT 4 01/22/60	110,000.00	156,409.00	
UKT 4.25 03/07/36	180,000.00	222,552.00	
UKT 4.25 06/07/32	170,000.00	206,323.90	
UKT 4.25 09/07/39	130,000.00	163,974.20	
UKT 4.25 12/07/27	130,000.00	146,866.20	
UKT 4.25 12/07/40	140,000.00	178,014.20	
UKT 4.25 12/07/46	160,000.00	211,352.00	
UKT 4.25 12/07/49	90,000.00	121,977.90	
UKT 4.25 12/07/55	120,000.00	172,048.80	
UKT 4.5 09/07/34	150,000.00	188,518.50	
UKT 4.5 12/07/42	110,000.00	146,098.70	
UKT 4.75 12/07/30	160,000.00	197,633.60	
UKT 4.75 12/07/38	70,000.00	93,156.70	
UKT 5 03/07/25	80,000.00	86,667.20	
UKT 6 12/07/28	100,000.00	126,232.00	
イギリス・ボンド小計		7,130,000.00	7,284,927.10 (1,178,555,506)
イスラエル・シュケル	ILGOV 1 03/31/30	150,000.00	135,240.00
	ILGOV 1.5 05/31/37	260,000.00	216,062.60
	ILGOV 1.5 11/30/23	650,000.00	646,633.00
	ILGOV 1.75 08/31/25	230,000.00	227,217.00
	ILGOV 2.25 09/28/28	190,000.00	188,856.20
	ILGOV 3.75 03/31/24	120,000.00	123,238.80
	ILGOV 3.75 03/31/47	290,000.00	319,600.30
	ILGOV 5.5 01/31/42	90,000.00	122,685.30
ILGOV 6.25 10/30/26	300,000.00	348,009.00	
イスラエル・シュケル小計		2,280,000.00	2,327,542.20 (90,998,754)
デンマーク・ク	DGB 0 11/15/24	460,000.00	455,101.00
	DGB 0 11/15/31	430,000.00	388,019.10

ローネ	DGB 0.25 11/15/52	480,000.00	343,507.20	
	DGB 0.5 11/15/27	560,000.00	550,782.40	
	DGB 0.5 11/15/29	730,000.00	705,815.10	
	DGB 1.5 11/15/23	400,000.00	406,260.00	
	DGB 1.75 11/15/25	480,000.00	497,889.60	
	DGB 4.5 11/15/39	1,000,000.00	1,468,040.00	
デンマーク・クローネ小計		4,540,000.00	4,815,414.40 (87,785,005)	
ノル ウェー・ クローネ	NGB 1.25 09/17/31	230,000.00	202,011.30	
	NGB 1.375 08/19/30	510,000.00	459,948.60	
	NGB 1.5 02/19/26	440,000.00	422,290.00	
	NGB 1.75 02/17/27	240,000.00	230,584.80	
	NGB 1.75 03/13/25	590,000.00	575,645.30	
	NGB 1.75 09/06/29	580,000.00	543,709.40	
	NGB 2 04/26/28	360,000.00	346,730.40	
	NGB 2.125 05/18/32	240,000.00	226,248.00	
	NGB 3 03/14/24	500,000.00	502,715.00	
ノルウェー・クローネ小計		3,690,000.00	3,509,882.80 (48,155,592)	
スウェー デン・ク ローナ	SGB 0.125 05/12/31	350,000.00	313,953.50	
	SGB 0.75 05/12/28	670,000.00	645,082.70	
	SGB 0.75 11/12/29	560,000.00	534,357.60	
	SGB 1 11/12/26	680,000.00	664,489.20	
	SGB 1.5 11/13/23	750,000.00	748,275.00	
	SGB 2.25 06/01/32	500,000.00	542,520.00	
	SGB 2.5 05/12/25	800,000.00	816,808.00	
	SGB 3.5 03/30/39	340,000.00	447,290.40	
スウェーデン・クローナ小計		4,650,000.00	4,712,776.40 (61,548,860)	
メキシ コ・ペソ	MBONO 10 11/20/36	320,000.00	354,832.00	
	MBONO 10 12/05/24	2,550,000.00	2,592,789.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	4,140,000.00	3,751,999.20	
	MBONO 7.5 06/03/27	2,450,000.00	2,333,478.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	3,040,000.00	2,871,067.20	
	MBONO 7.75 11/13/42	2,000,000.00	1,801,340.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	1,520,000.00	1,412,824.80	
	MBONO 8 09/05/24	2,980,000.00	2,910,268.00	
	MBONO 8 11/07/47	1,990,000.00	1,833,665.60	
	MBONO 8 12/07/23	2,160,000.00	2,119,651.20	
	MBONO 8.5 05/31/29	2,870,000.00	2,843,309.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	2,500,000.00	2,434,500.00	
メキシコ・ペソ小計		28,520,000.00	27,259,724.00 (177,787,920)	
オフショ	CGB 2.28 03/17/24	4,000,000.00	4,011,880.00	

ア・人民 元	CGB 2.47 09/02/24	1,000,000.00	1,005,230.00	
	CGB 2.48 04/15/27	1,000,000.00	998,840.00	
	CGB 2.56 10/21/23	4,000,000.00	4,027,320.00	
	CGB 2.69 08/12/26	4,000,000.00	4,034,360.00	
	CGB 2.91 10/14/28	7,000,000.00	7,092,610.00	
	CGB 3.02 05/27/31	5,000,000.00	5,087,750.00	
	CGB 3.72 04/12/51	3,000,000.00	3,226,110.00	
オフショア・人民元小計		29,000,000.00	29,484,100.00	(580,028,906)
ポーラン ド・ズロ チ	POLGB 0.25 10/25/26	860,000.00	676,605.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	440,000.00	381,744.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	280,000.00	203,714.00	
	POLGB 1.75 04/25/32	150,000.00	108,157.50	
	POLGB 2.25 10/25/24	1,070,000.00	978,675.50	
	POLGB 2.75 10/25/29	480,000.00	401,424.00	
	POLGB 3.75 05/25/27	720,000.00	650,844.00	
ポーランド・ズロチ小計		4,000,000.00	3,401,164.00	(97,464,436)
ユーロ	BGB 0 10/22/27	105,000.00	100,838.85	
	BGB 0 10/22/31	140,000.00	124,546.80	
	BGB 0.1 06/22/30	120,000.00	110,844.00	
	BGB 0.2 10/22/23	80,000.00	79,958.40	
	BGB 0.35 06/22/32	80,000.00	72,208.80	
	BGB 0.4 06/22/40	90,000.00	69,519.60	
	BGB 0.5 10/22/24	90,000.00	90,340.20	
	BGB 0.65 06/22/71	30,000.00	17,699.40	
	BGB 0.8 06/22/25	170,000.00	171,739.10	
	BGB 0.8 06/22/27	130,000.00	130,457.60	
	BGB 0.8 06/22/28	130,000.00	129,636.00	
	BGB 0.9 06/22/29	170,000.00	169,005.50	
	BGB 1 06/22/26	140,000.00	142,035.60	
	BGB 1 06/22/31	160,000.00	157,059.20	
	BGB 1.25 04/22/33	100,000.00	98,729.00	
	BGB 1.4 06/22/53	60,000.00	50,386.80	
	BGB 1.45 06/22/37	60,000.00	57,349.80	
	BGB 1.6 06/22/47	100,000.00	91,326.00	
	BGB 1.7 06/22/50	100,000.00	92,225.00	
	BGB 1.9 06/22/38	90,000.00	91,131.30	
	BGB 2.15 06/22/66	130,000.00	133,673.80	
	BGB 2.6 06/22/24	170,000.00	177,294.70	
	BGB 3 06/22/34	80,000.00	92,150.40	
	BGB 3.75 06/22/45	90,000.00	118,215.00	
BGB 4 03/28/32	80,000.00	99,864.80		
BGB 4.25 03/28/41	150,000.00	202,548.00		

BGB 4.5 03/28/26	100,000.00	114,228.00	
BGB 5 03/28/35	160,000.00	221,448.00	
BGB 5.5 03/28/28	160,000.00	202,128.00	
BKO 0 09/15/23	210,000.00	209,668.20	
BTPS	220,000.00	213,934.60	
BTPS 0 01/30/24	240,000.00	236,080.80	
BTPS 0 04/15/24	250,000.00	244,830.00	
BTPS 0 08/01/26	50,000.00	46,112.00	
BTPS 0 11/29/23	190,000.00	187,089.20	
BTPS 0 12/15/24	60,000.00	57,877.80	
BTPS 0.25 03/15/28	100,000.00	88,676.00	
BTPS 0.3 08/15/23	100,000.00	99,391.00	
BTPS 0.35 02/01/25	170,000.00	164,940.80	
BTPS 0.45 02/15/29	290,000.00	253,051.10	
BTPS 0.5 02/01/26	170,000.00	162,098.40	
BTPS 0.5 07/15/28	250,000.00	223,075.00	
BTPS 0.6 08/01/31	120,000.00	98,047.20	
BTPS 0.65 10/15/23	160,000.00	159,260.80	
BTPS 0.85 01/15/27	240,000.00	227,198.40	
BTPS 0.9 04/01/31	170,000.00	144,263.70	
BTPS 0.95 03/01/37	190,000.00	140,630.40	
BTPS 0.95 06/01/32	160,000.00	132,200.00	
BTPS 0.95 08/01/30	180,000.00	156,241.80	
BTPS 0.95 09/15/27	120,000.00	112,474.80	
BTPS 0.95 12/01/31	200,000.00	167,588.00	
BTPS 1.1 04/01/27	50,000.00	47,539.50	
BTPS 1.25 12/01/26	270,000.00	261,098.10	
BTPS 1.35 04/01/30	370,000.00	335,160.80	
BTPS 1.45 03/01/36	190,000.00	154,449.10	
BTPS 1.45 05/15/25	200,000.00	198,540.00	
BTPS 1.45 11/15/24	250,000.00	249,655.00	
BTPS 1.5 04/30/45	130,000.00	93,727.40	
BTPS 1.5 06/01/25	240,000.00	238,651.20	
BTPS 1.6 06/01/26	230,000.00	227,272.20	
BTPS 1.65 03/01/32	240,000.00	214,459.20	
BTPS 1.65 12/01/30	210,000.00	191,811.90	
BTPS 1.7 09/01/51	140,000.00	99,086.40	
BTPS 1.8 03/01/41	190,000.00	150,869.50	
BTPS 1.85 05/15/24	330,000.00	333,171.30	
BTPS 2 02/01/28	320,000.00	314,550.40	
BTPS 2 12/01/25	220,000.00	221,190.20	
BTPS 2.05 08/01/27	280,000.00	277,438.00	
BTPS 2.1 07/15/26	250,000.00	251,057.50	
BTPS 2.15 03/01/72	50,000.00	36,386.00	

BTPS 2.15 09/01/52	70,000.00	53,795.70	
BTPS 2.2 06/01/27	180,000.00	179,973.00	
BTPS 2.25 09/01/36	120,000.00	107,280.00	
BTPS 2.45 09/01/33	150,000.00	140,863.50	
BTPS 2.45 09/01/50	150,000.00	125,932.50	
BTPS 2.45 10/01/23	320,000.00	325,046.40	
BTPS 2.5 11/15/25	240,000.00	244,934.40	
BTPS 2.5 12/01/24	130,000.00	132,883.40	
BTPS 2.7 03/01/47	90,000.00	81,182.70	
BTPS 2.8 03/01/67	90,000.00	76,484.70	
BTPS 2.8 12/01/28	120,000.00	122,316.00	
BTPS 2.95 09/01/38	100,000.00	96,263.00	
BTPS 3 08/01/29	200,000.00	205,058.00	
BTPS 3.1 03/01/40	120,000.00	117,278.40	
BTPS 3.25 03/01/38	70,000.00	69,608.00	
BTPS 3.25 09/01/46	180,000.00	179,258.40	
BTPS 3.35 03/01/35	110,000.00	111,991.00	
BTPS 3.45 03/01/48	180,000.00	183,889.80	
BTPS 3.5 03/01/30	140,000.00	148,407.00	
BTPS 3.75 09/01/24	150,000.00	157,207.50	
BTPS 3.85 09/01/49	100,000.00	108,547.00	
BTPS 4 02/01/37	250,000.00	273,547.50	
BTPS 4.5 03/01/24	70,000.00	73,633.70	
BTPS 4.5 03/01/26	310,000.00	338,740.10	
BTPS 4.75 09/01/28	140,000.00	157,840.20	
BTPS 4.75 09/01/44	170,000.00	207,648.20	
BTPS 5 03/01/25	170,000.00	184,693.10	
BTPS 5 08/01/34	220,000.00	261,307.20	
BTPS 5 08/01/39	140,000.00	171,561.60	
BTPS 5 09/01/40	180,000.00	220,480.20	
BTPS 5.25 11/01/29	250,000.00	294,755.00	
BTPS 5.75 02/01/33	240,000.00	298,464.00	
BTPS 6 05/01/31	250,000.00	312,027.50	
BTPS 6.5 11/01/27	190,000.00	231,110.30	
BTPS 9 11/01/23	170,000.00	186,552.90	
DBR 0 02/15/30	210,000.00	200,510.10	
DBR 0 02/15/31	350,000.00	330,193.50	
DBR 0 02/15/32	210,000.00	195,365.10	
DBR 0 05/15/35	200,000.00	176,964.00	
DBR 0 05/15/36	200,000.00	174,562.00	
DBR 0 08/15/26	320,000.00	315,507.20	
DBR 0 08/15/29	250,000.00	239,850.00	
DBR 0 08/15/30	340,000.00	322,738.20	
DBR 0 08/15/31	380,000.00	356,523.60	

DBR 0 08/15/50	230,000.00	171,467.30	
DBR 0 08/15/50	130,000.00	97,260.80	
DBR 0 08/15/52	110,000.00	80,044.80	
DBR 0 11/15/27	220,000.00	214,418.60	
DBR 0 11/15/28	200,000.00	193,264.00	
DBR 0.25 02/15/27	320,000.00	317,881.60	
DBR 0.25 02/15/29	250,000.00	245,035.00	
DBR 0.25 08/15/28	220,000.00	216,015.80	
DBR 0.5 02/15/25	230,000.00	231,444.40	
DBR 0.5 02/15/26	150,000.00	151,011.00	
DBR 0.5 02/15/28	230,000.00	229,749.30	
DBR 0.5 08/15/27	100,000.00	100,215.00	
DBR 1 08/15/24	160,000.00	162,430.40	
DBR 1 08/15/25	300,000.00	306,498.00	
DBR 1.25 08/15/48	280,000.00	292,096.00	
DBR 1.5 05/15/24	390,000.00	399,344.40	
DBR 1.75 02/15/24	240,000.00	246,187.20	
DBR 2 08/15/23	250,000.00	254,487.50	
DBR 2.5 07/04/44	260,000.00	334,266.40	
DBR 2.5 08/15/46	270,000.00	353,268.00	
DBR 3.25 07/04/42	180,000.00	251,915.40	
DBR 4 01/04/37	260,000.00	364,319.80	
DBR 4.25 07/04/39	170,000.00	254,165.30	
DBR 4.75 07/04/28	170,000.00	211,576.90	
DBR 4.75 07/04/34	230,000.00	331,517.40	
DBR 4.75 07/04/40	220,000.00	352,000.00	
DBR 5.5 01/04/31	80,000.00	111,704.80	
DBR 5.625 01/04/28	160,000.00	203,974.40	
DBR 6.25 01/04/30	130,000.00	183,231.10	
DBR 6.5 07/04/27	160,000.00	206,891.20	
FRANCE O.A.T.	80,000.00	57,566.40	
FRTR 0 02/25/24	300,000.00	299,100.00	
FRTR 0 02/25/26	240,000.00	234,981.60	
FRTR 0 02/25/27	350,000.00	338,439.50	
FRTR 0 03/25/24	410,000.00	408,560.90	
FRTR 0 03/25/25	510,000.00	502,854.90	
FRTR 0 05/25/32	310,000.00	273,240.20	
FRTR 0 11/25/29	400,000.00	371,360.00	
FRTR 0 11/25/30	430,000.00	390,960.30	
FRTR 0 11/25/31	390,000.00	348,121.80	
FRTR 0.25 11/25/26	360,000.00	353,113.20	
FRTR 0.5 05/25/25	450,000.00	449,622.00	
FRTR 0.5 05/25/26	480,000.00	477,489.60	
FRTR 0.5 05/25/29	570,000.00	552,951.30	

FRTR 0.5 05/25/40	180,000.00	144,590.40	
FRTR 0.5 05/25/72	80,000.00	44,883.20	
FRTR 0.5 06/25/44	120,000.00	90,309.60	
FRTR 0.75 05/25/28	560,000.00	556,483.20	
FRTR 0.75 05/25/52	280,000.00	205,618.00	
FRTR 0.75 11/25/28	460,000.00	455,947.40	
FRTR 1 05/25/27	360,000.00	364,262.40	
FRTR 1 11/25/25	450,000.00	456,340.50	
FRTR 1.25 05/25/34	340,000.00	330,609.20	
FRTR 1.25 05/25/36	390,000.00	373,042.80	
FRTR 1.5 05/25/31	480,000.00	494,304.00	
FRTR 1.5 05/25/50	270,000.00	245,816.10	
FRTR 1.75 05/25/66	120,000.00	112,406.40	
FRTR 1.75 06/25/39	300,000.00	303,063.00	
FRTR 1.75 11/25/24	340,000.00	350,427.80	
FRTR 2 05/25/48	280,000.00	284,695.60	
FRTR 2.25 05/25/24	350,000.00	362,330.50	
FRTR 2.5 05/25/30	470,000.00	522,132.40	
FRTR 2.75 10/25/27	470,000.00	517,446.50	
FRTR 3.25 05/25/45	280,000.00	350,943.60	
FRTR 3.5 04/25/26	410,000.00	453,365.70	
FRTR 4 04/25/55	230,000.00	335,901.20	
FRTR 4 04/25/60	170,000.00	255,222.70	
FRTR 4 10/25/38	220,000.00	291,255.80	
FRTR 4.25 10/25/23	340,000.00	356,673.60	
FRTR 4.5 04/25/41	330,000.00	468,831.00	
FRTR 4.75 04/25/35	300,000.00	411,735.00	
FRTR 5.5 04/25/29	240,000.00	311,126.40	
FRTR 5.75 10/25/32	340,000.00	484,306.20	
FRTR 6 10/25/25	180,000.00	211,352.40	
IRISH 0 10/18/31	100,000.00	88,396.00	
IRISH 0.2 05/15/27	60,000.00	58,323.60	
IRISH 0.2 10/18/30	40,000.00	36,843.20	
IRISH 0.9 05/15/28	50,000.00	49,906.00	
IRISH 1 05/15/26	120,000.00	121,614.00	
IRISH 1.1 05/15/29	100,000.00	100,541.00	
IRISH 1.3 05/15/33	50,000.00	49,006.00	
IRISH 1.35 03/18/31	60,000.00	60,751.80	
IRISH 1.5 05/15/50	70,000.00	62,988.10	
IRISH 1.7 05/15/37	70,000.00	70,684.60	
IRISH 2 02/18/45	100,000.00	102,531.00	
IRISH 2.4 05/15/30	100,000.00	109,769.00	
IRISH 3.4 03/18/24	80,000.00	83,980.80	
IRISH 5.4 03/13/25	100,000.00	112,628.00	

IRISH GOVT	50,000.00	40,090.50	
NETHER 0 01/15/24	140,000.00	139,631.80	
NETHER 0 01/15/26	60,000.00	58,889.40	
NETHER 0 01/15/27	90,000.00	87,562.80	
NETHER 0 01/15/29	110,000.00	104,079.80	
NETHER 0 01/15/38	80,000.00	64,922.40	
NETHER 0 01/15/52	130,000.00	87,100.00	
NETHER 0 07/15/30	120,000.00	111,510.00	
NETHER 0 07/15/31	80,000.00	73,280.00	
NETHER 0.25 07/15/25	210,000.00	208,966.80	
NETHER 0.25 07/15/29	130,000.00	124,696.00	
NETHER 0.5 01/15/40	110,000.00	95,343.60	
NETHER 0.5 07/15/26	160,000.00	159,604.80	
NETHER 0.5 07/15/32	100,000.00	94,216.00	
NETHER 0.75 07/15/27	170,000.00	170,742.90	
NETHER 0.75 07/15/28	140,000.00	139,855.80	
NETHER 2 07/15/24	170,000.00	175,625.30	
NETHER 2.5 01/15/33	140,000.00	158,624.20	
NETHER 2.75 01/15/47	200,000.00	258,010.00	
NETHER 3.75 01/15/42	150,000.00	211,279.50	
NETHER 4 01/15/37	130,000.00	175,449.30	
NETHER 5.5 01/15/28	90,000.00	113,067.00	
OBL 0 04/05/24	410,000.00	409,139.00	
OBL 0 04/10/26	180,000.00	177,679.80	
OBL 0 04/11/25	190,000.00	188,569.30	
OBL 0 04/16/27	150,000.00	146,941.50	
OBL 0 10/09/26	170,000.00	167,094.70	
OBL 0 10/10/25	310,000.00	307,671.90	
OBL 0 10/13/23	200,000.00	199,690.00	
OBL 0 10/18/24	140,000.00	139,263.60	
RAGB 0 02/20/30	120,000.00	110,491.20	
RAGB 0 02/20/31	100,000.00	90,062.00	
RAGB 0 04/20/25	60,000.00	59,200.20	
RAGB 0 07/15/24	160,000.00	159,134.40	
RAGB 0 10/20/28	30,000.00	28,191.00	
RAGB 0 10/20/40	50,000.00	36,372.50	
RAGB 0.25 10/20/36	110,000.00	90,775.30	
RAGB 0.5 02/20/29	110,000.00	106,628.50	
RAGB 0.5 04/20/27	100,000.00	98,927.00	
RAGB 0.7 04/20/71	50,000.00	32,577.00	
RAGB 0.75 02/20/28	130,000.00	128,870.30	
RAGB 0.75 03/20/51	80,000.00	62,676.00	
RAGB 0.75 10/20/26	150,000.00	150,984.00	
RAGB 0.9 02/20/32	50,000.00	48,032.50	

RAGB 1.2 10/20/25	100,000.00	102,161.00	
RAGB 1.5 02/20/47	70,000.00	67,669.00	
RAGB 1.5 11/02/86	100,000.00	88,031.00	
RAGB 1.65 10/21/24	80,000.00	82,167.20	
RAGB 1.75 10/20/23	80,000.00	81,414.40	
RAGB 2.4 05/23/34	60,000.00	66,141.60	
RAGB 3.15 06/20/44	50,000.00	63,596.50	
RAGB 3.8 01/26/62	50,000.00	77,267.00	
RAGB 4.15 03/15/37	100,000.00	132,380.00	
RAGB 4.85 03/15/26	100,000.00	115,482.00	
RAGB 6.25 07/15/27	60,000.00	76,554.00	
RFGB 0 09/15/23	60,000.00	59,849.40	
RFGB 0 09/15/24	60,000.00	59,550.00	
RFGB 0 09/15/26	40,000.00	38,836.00	
RFGB 0 09/15/30	70,000.00	63,870.80	
RFGB 0.125 04/15/36	40,000.00	32,987.20	
RFGB 0.125 04/15/52	20,000.00	13,018.00	
RFGB 0.125 09/15/31	40,000.00	36,242.40	
RFGB 0.25 09/15/40	50,000.00	38,834.50	
RFGB 0.5 04/15/26	70,000.00	69,626.20	
RFGB 0.5 04/15/43	30,000.00	23,485.20	
RFGB 0.5 09/15/27	40,000.00	39,395.60	
RFGB 0.5 09/15/29	50,000.00	48,251.00	
RFGB 0.75 04/15/31	60,000.00	58,132.80	
RFGB 0.875 09/15/25	100,000.00	100,973.00	
RFGB 1.125 04/15/34	50,000.00	48,243.50	
RFGB 1.375 04/15/47	50,000.00	47,446.00	
RFGB 2.625 07/04/42	40,000.00	46,009.60	
RFGB 2.75 07/04/28	100,000.00	110,806.00	
SPGB 0 01/31/25	380,000.00	373,509.60	
SPGB 0 01/31/26	210,000.00	203,613.90	
SPGB 0 01/31/27	210,000.00	200,354.70	
SPGB 0 01/31/28	160,000.00	149,996.80	
SPGB 0 05/31/24	230,000.00	227,815.00	
SPGB 0.1 04/30/31	190,000.00	165,784.50	
SPGB 0.25 07/30/24	180,000.00	178,840.80	
SPGB 0.5 04/30/30	230,000.00	213,449.20	
SPGB 0.5 10/31/31	200,000.00	178,954.00	
SPGB 0.6 10/31/29	220,000.00	207,713.00	
SPGB 0.7 04/30/32	150,000.00	135,069.00	
SPGB 0.8 07/30/27	120,000.00	118,316.40	
SPGB 0.85 07/30/37	120,000.00	98,499.60	
SPGB 1 10/31/50	190,000.00	133,815.10	
SPGB 1.2 10/31/40	140,000.00	116,079.60	

SPGB 1.25 10/31/30	240,000.00	234,103.20	
SPGB 1.3 10/31/26	150,000.00	152,221.50	
SPGB 1.4 04/30/28	280,000.00	283,250.80	
SPGB 1.4 07/30/28	180,000.00	181,706.40	
SPGB 1.45 04/30/29	230,000.00	231,633.00	
SPGB 1.45 10/31/27	180,000.00	183,006.00	
SPGB 1.45 10/31/71	70,000.00	46,426.80	
SPGB 1.5 04/30/27	190,000.00	194,071.70	
SPGB 1.85 07/30/35	200,000.00	194,866.00	
SPGB 1.9 10/31/52	70,000.00	60,027.80	
SPGB 1.95 04/30/26	390,000.00	405,061.80	
SPGB 1.95 07/30/30	210,000.00	216,531.00	
SPGB 2.15 10/31/25	160,000.00	167,425.60	
SPGB 2.35 07/30/33	160,000.00	166,836.80	
SPGB 2.55 10/31/32	110,000.00	116,463.60	
SPGB 2.7 10/31/48	160,000.00	168,643.20	
SPGB 2.75 10/31/24	230,000.00	241,325.20	
SPGB 2.9 10/31/46	150,000.00	164,239.50	
SPGB 3.45 07/30/66	110,000.00	130,572.20	
SPGB 3.8 04/30/24	80,000.00	84,502.40	
SPGB 4.2 01/31/37	180,000.00	226,488.60	
SPGB 4.4 10/31/23	300,000.00	314,205.00	
SPGB 4.65 07/30/25	140,000.00	156,795.80	
SPGB 4.7 07/30/41	200,000.00	274,652.00	
SPGB 4.8 01/31/24	140,000.00	148,873.20	
SPGB 4.9 07/30/40	180,000.00	250,327.80	
SPGB 5.15 10/31/28	250,000.00	308,075.00	
SPGB 5.15 10/31/44	160,000.00	238,233.60	
SPGB 5.75 07/30/32	220,000.00	300,405.60	
SPGB 5.9 07/30/26	110,000.00	131,690.90	
SPGB 6 01/31/29	160,000.00	207,379.20	
ユーロ小計	57,655,000.00	59,263,429.05 (8,044,417,859)	
国債証券合計		23,199,395,040 (23,199,395,040)	
合計		23,199,395,040 (23,199,395,040)	

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

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	202銘柄	48.7%	50.7%
カナダ・ドル	国債証券	28銘柄	2.1%	2.1%
オーストラリア・ドル	国債証券	24銘柄	1.5%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券	12銘柄	0.9%	0.9%
イギリス・ポンド	国債証券	54銘柄	4.9%	5.1%

イスラエル・シケル	国債証券	9銘柄	0.4%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.3%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券	12銘柄	0.7%	0.8%
オフショア・人民元	国債証券	8銘柄	2.4%	2.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	7銘柄	0.4%	0.4%
ユーロ	国債証券	321銘柄	33.3%	34.7%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2022年8月1日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	138,704,746
金銭信託	17,768,492
コール・ローン	526,968,160
国債証券	156,171,761,017
派生商品評価勘定	11,136,847
未収入金	3,049,914,345
未収利息	1,087,826,643
前払費用	56,580,598
流動資産合計	161,060,660,848
資産合計	
161,060,660,848	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,382,035
未払金	3,060,814,480
未払解約金	163,009,633
その他未払費用	1,208
流動負債合計	3,234,207,356
負債合計	
3,234,207,356	
純資産の部	
元本等	
元本	77,955,555,827
剰余金	
剰余金又は欠損金()	79,870,897,665
元本等合計	157,826,453,492
純資産合計	
157,826,453,492	
負債純資産合計	
161,060,660,848	

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	77,955,555,827口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0246円 (1万口当たりの純資産額20,246円)

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>

<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p>	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年8月1日現在)
----	---------------

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	2,092,633,069	-	2,100,387,191	7,754,122
	カナダ・ドル	101,737,857	-	102,132,860	395,003
	シンガポール・ドル	88,192,883	-	88,480,868	287,985
	イギリス・ポンド	208,932,551	-	209,565,401	632,850
	オフショア・人民元	360,674,512	-	362,263,890	1,589,378
	ユーロ	208,609,951	-	209,087,460	477,509
	小計	3,060,780,823	-	3,071,917,670	11,136,847
	売建				
	アメリカ・ドル	2,208,067,513	-	2,216,249,370	8,181,857
	シンガポール・ドル	115,351,447	-	115,728,116	376,669
	イギリス・ポンド	207,636,548	-	208,265,473	628,925
	ユーロ	521,879,486	-	523,074,070	1,194,584
小計	3,052,934,994	-	3,063,317,029	10,382,035	
合 計		6,113,715,817	-	6,135,234,699	754,812

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

たレートを用いております。

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年8月1日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	82,429,960,917円
同期中における追加設定元本額	11,244,458,145円
同期中における一部解約元本額	15,718,863,235円
2022年8月1日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	25,059,860,115円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	799,143,327円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,102,477,258円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,137,633,285円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	148,222,388円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,352,663円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	27,407,362円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	91,330,725円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	240,104,273円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	168,598,202円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	272,077,645円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,201,846円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	75,953,533円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	105,895,963円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	71,983,977円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	19,402,284円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	74,074,775円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	54,866,068円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	142,807,187円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	41,466,035円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	20,522,235円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	143,535,545円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	540,131,808円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	30,988,366円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	84,644,532円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	55,851,169円

三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,451,947円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	296,483,870円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	15,039,756円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,811,135,474円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	33,601,811円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	6,238,321,125円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,121,395,220円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,458,742,581円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	30,929,407円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	82,222,515円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	658,062,897円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	111,106,124円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	965,401,491円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,298,450,320円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,413,342,601円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,326,790,546円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,306,207,380円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	310,999,696円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	129,221,725円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	74,297,765円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	33,189,008円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,647,293円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	86,587,428円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	385,856,517円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	92,304,938円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	38,868,189円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,201,986円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	936,546,894円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	553,642,681円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	814,152,058円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	551,216,482円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	299,310,481円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	198,130,405円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	147,179,467円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	188,308,584円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,391,071,883円
合計	77,955,555,827円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.125 02/15/24	7,700,000.00	7,375,137.00	
		T 0.125 08/15/23	8,000,000.00	7,769,680.00	
		T 0.125 10/15/23	5,700,000.00	5,514,294.00	
		T 0.25 05/31/25	4,400,000.00	4,091,120.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,691,084.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	277,839.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,845,000.00	
		T 0.25 11/15/23	3,000,000.00	2,898,270.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,804,280.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,229,275.00	
		T 0.375 09/15/24	3,000,000.00	2,845,290.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,259,232.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,846,320.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,763,270.00	
		T 0.5 03/31/25	600,000.00	563,856.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,081,872.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,250,675.00	
		T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,593,560.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,181,168.00	
		T 0.625 05/15/30	7,500,000.00	6,440,325.00	
		T 0.625 07/31/26	3,600,000.00	3,310,020.00	
		T 0.625 08/15/30	7,000,000.00	5,986,610.00	
		T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,189,416.00	
		T 0.625 11/30/27	2,100,000.00	1,881,138.00	
		T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,438,312.00	
		T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,302,153.00	
		T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,955,392.00	
		T 0.875 01/31/24	2,000,000.00	1,938,900.00	
		T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	6,100,920.00	
		T 1 07/31/28	5,900,000.00	5,337,140.00	
		T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,308,030.00	
		T 1.125 01/15/25	2,000,000.00	1,917,560.00	
		T 1.125 02/15/31	8,500,000.00	7,541,030.00	
		T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,435,650.00	
		T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,862,100.00	
		T 1.125 05/15/40	2,000,000.00	1,442,340.00	
		T 1.125 08/15/40	3,200,000.00	2,293,472.00	
		T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,189,375.00	
		T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	3,376,353.00	
		T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,758,350.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,626,752.00			
T 1.25 09/30/28	4,500,000.00	4,127,670.00			
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,946,824.00			

T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,158,849.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,832,151.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	3,080,025.00	
T 1.375 08/31/23	2,500,000.00	2,458,300.00	
T 1.375 08/31/26	7,100,000.00	6,724,978.00	
T 1.375 09/30/23	3,000,000.00	2,945,610.00	
T 1.375 10/31/28	6,000,000.00	5,537,340.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,393,536.00	
T 1.375 11/15/40	2,000,000.00	1,490,920.00	
T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,308,200.00	
T 1.5 01/31/27	4,400,000.00	4,172,608.00	
T 1.5 02/15/25	3,000,000.00	2,899,200.00	
T 1.5 02/15/30	4,500,000.00	4,154,040.00	
T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,337,530.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	775,248.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,137,183.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,786,465.00	
T 1.625 05/15/26	14,950,000.00	14,330,920.50	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	5,072,650.00	
T 1.625 08/15/29	450,000.00	420,853.50	
T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,730,272.00	
T 1.625 10/31/23	3,000,000.00	2,952,180.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	2,337,472.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	190,936.00	
T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	4,059,114.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,458,150.00	
T 1.75 06/30/24	6,200,000.00	6,069,676.00	
T 1.75 07/31/24	850,000.00	831,470.00	
T 1.75 08/15/41	2,900,000.00	2,286,911.00	
T 1.75 11/15/29	2,000,000.00	1,885,780.00	
T 1.75 12/31/26	3,500,000.00	3,360,105.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,958,362.00	
T 1.875 02/15/41	2,800,000.00	2,272,788.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	4,518,548.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,277,940.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,664,788.00	
T 1.875 08/31/24	3,800,000.00	3,720,124.00	
T 1.875 11/15/51	1,300,000.00	1,014,000.00	
T 2 02/15/25	3,500,000.00	3,426,570.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	2,253,328.00	
T 2 04/30/24	2,000,000.00	1,968,280.00	
T 2 05/31/24	3,300,000.00	3,246,606.00	
T 2 06/30/24	4,100,000.00	4,032,719.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,220,074.00	

T 2 08/15/51	4,700,000.00	3,769,541.00	
T 2 11/15/26	5,000,000.00	4,847,450.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	3,131,428.00	
T 2.125 02/29/24	2,000,000.00	1,974,200.00	
T 2.125 03/31/24	6,500,000.00	6,412,640.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	588,348.00	
T 2.125 07/31/24	3,500,000.00	3,447,500.00	
T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	3,937,800.00	
T 2.125 11/30/23	3,100,000.00	3,065,125.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,555,514.00	
T 2.25 01/31/24	2,200,000.00	2,176,966.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,306,148.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,452,225.00	
T 2.25 03/31/26	13,300,000.00	13,054,216.00	
T 2.25 04/30/24	3,800,000.00	3,756,338.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,591,580.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	4,105,962.00	
T 2.25 08/15/46	2,450,000.00	2,041,707.50	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,977,730.00	
T 2.25 10/31/24	800,000.00	789,496.00	
T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	5,029,467.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,931,840.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,295,984.00	
T 2.25 12/31/23	3,000,000.00	2,970,210.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,843,450.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,460,052.00	
T 2.375 02/29/24	3,700,000.00	3,667,033.00	
T 2.375 03/31/29	2,800,000.00	2,742,880.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,951,700.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,354,424.00	
T 2.375 05/15/51	1,400,000.00	1,225,980.00	
T 2.375 08/15/24	5,600,000.00	5,540,472.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,662,785.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,370,488.00	
T 2.5 02/15/45	3,600,000.00	3,154,500.00	
T 2.5 02/15/46	2,900,000.00	2,542,256.00	
T 2.5 02/28/26	8,500,000.00	8,423,585.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,971,860.00	
T 2.5 05/15/24	5,700,000.00	5,658,561.00	
T 2.5 05/15/46	3,600,000.00	3,155,040.00	
T 2.5 08/15/23	5,000,000.00	4,976,350.00	
T 2.625 01/31/26	2,700,000.00	2,686,905.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,793,106.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	994,450.00	

T 2.625 04/15/25	2,500,000.00	2,484,075.00	
T 2.625 05/31/27	3,000,000.00	2,990,250.00	
T 2.625 12/31/23	1,900,000.00	1,891,374.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,393,210.00	
T 2.75 02/15/24	5,100,000.00	5,084,445.00	
T 2.75 02/15/28	4,800,000.00	4,806,000.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,994,140.00	
T 2.75 04/30/27	2,700,000.00	2,704,212.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,991,420.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,404,424.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	898,029.00	
T 2.75 07/31/23	2,000,000.00	1,995,700.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,855,460.00	
T 2.75 08/15/47	3,300,000.00	3,044,481.00	
T 2.75 08/31/23	3,800,000.00	3,791,982.00	
T 2.75 08/31/25	2,100,000.00	2,094,750.00	
T 2.75 11/15/23	4,200,000.00	4,190,130.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	277,896.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,386,315.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	400,060.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,538,255.00	
T 2.875 05/15/28	9,000,000.00	9,070,290.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,814,399.00	
T 2.875 05/15/43	2,400,000.00	2,264,232.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,351,098.00	
T 2.875 05/15/52	900,000.00	882,135.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	3,101,550.00	
T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	2,001,640.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,537,575.00	
T 2.875 08/15/45	3,300,000.00	3,094,245.00	
T 2.875 10/31/23	1,000,000.00	999,140.00	
T 2.875 11/15/46	800,000.00	752,312.00	
T 2.875 11/30/23	2,000,000.00	1,997,180.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,508,000.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	2,408,200.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	2,334,744.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	3,255,120.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	777,560.00	
T 3 05/15/45	3,000,000.00	2,871,300.00	
T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,736,010.00	
T 3 08/15/48	900,000.00	879,111.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	1,005,660.00	
T 3 10/31/25	1,100,000.00	1,106,952.00	
T 3 11/15/44	3,500,000.00	3,351,495.00	

	T 3 11/15/45	2,700,000.00	2,592,189.00	
	T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	992,100.00	
	T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	2,258,117.00	
	T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,398,296.00	
	T 3.125 08/15/44	2,300,000.00	2,248,963.00	
	T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,968,411.00	
	T 3.25 05/15/42	1,000,000.00	1,010,150.00	
	T 3.375 05/15/44	500,000.00	509,920.00	
	T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	3,257,883.00	
	T 3.5 02/15/39	200,000.00	218,000.00	
	T 3.625 02/15/44	600,000.00	635,574.00	
	T 3.625 08/15/43	2,400,000.00	2,546,424.00	
	T 3.75 08/15/41	1,500,000.00	1,636,275.00	
	T 3.75 11/15/43	700,000.00	756,000.00	
	T 3.875 08/15/40	500,000.00	560,780.00	
	T 4.25 05/15/39	100,000.00	118,695.00	
	T 4.25 11/15/40	600,000.00	704,010.00	
	T 4.375 05/15/40	900,000.00	1,078,875.00	
	T 4.375 05/15/41	300,000.00	356,880.00	
	T 4.375 11/15/39	300,000.00	360,420.00	
	T 4.5 08/15/39	300,000.00	366,702.00	
	T 4.625 02/15/40	1,100,000.00	1,361,844.00	
	T 4.75 02/15/41	900,000.00	1,125,486.00	
	T 5.25 11/15/28	500,000.00	573,005.00	
	T 5.375 02/15/31	320,000.00	386,172.80	
	T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,107,570.00	
	T 6.25 08/15/23	800,000.00	826,936.00	
	T-BOND 15/11/2027	1,000,000.00	1,166,480.00	
	アメリカ・ドル小計	630,020,000.00	595,163,860.30 (79,103,228,672)	
カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,516,076.00	
	CAN 1 06/01/27	600,000.00	556,932.00	
	CAN 1.25 06/01/30	5,700,000.00	5,159,925.00	
	CAN 1.5 04/01/25	700,000.00	675,549.00	
	CAN 1.5 06/01/26	3,200,000.00	3,062,208.00	
	CAN 1.5 09/01/24	2,200,000.00	2,137,982.00	
	CAN 1.5 12/01/31	2,400,000.00	2,181,216.00	
	CAN 1.75 12/01/53	500,000.00	393,940.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	677,978.00	
	CAN 2 09/01/23	1,200,000.00	1,185,720.00	
	CAN 2.25 03/01/24	1,000,000.00	989,250.00	
	CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	492,315.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,800,000.00	1,764,234.00	
	CAN 2.25 12/01/29	1,600,000.00	1,567,104.00	

	CAN 2.5 06/01/24	2,100,000.00	2,084,229.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,500,000.00	1,490,460.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,343,268.00	
	CAN 4 06/01/41	1,600,000.00	1,875,744.00	
	CAN 5 06/01/37	600,000.00	760,098.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	299,302.50	
	CAN 5.75 06/01/33	400,000.00	514,428.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	694,624.00	
	カナダ・ドル小計	33,150,000.00	32,422,582.50 (3,363,842,934)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	800,000.00	737,744.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,500,000.00	3,964,860.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	347,145.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,800,000.00	1,741,662.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,250,000.00	2,175,255.00	
	ACGB 2.75 04/21/24	2,500,000.00	2,512,875.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	762,728.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	900,000.00	896,715.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	198,424.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	2,400,000.00	2,368,080.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	1,112,940.00	
	ACGB 3 11/21/33	1,000,000.00	989,710.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,319,955.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	816,256.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,970,860.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,200,000.00	1,266,612.00	
ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,264,186.50		
ACGB 4.5 04/21/33	900,000.00	1,016,082.00		
	オーストラリア・ドル小計	27,200,000.00	26,462,089.50 (2,455,946,526)	
シンガポール・ドル	SIGB 1.25 11/01/26	250,000.00	237,010.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	700,000.00	646,261.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	800,000.00	753,776.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	801,480.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	800,000.00	783,200.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	300,000.00	295,833.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	203,734.00	
	SIGB 3 09/01/24	1,000,000.00	1,009,210.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	600,000.00	640,572.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,500,000.00	1,557,960.00	
	シンガポール・ドル小計	6,950,000.00	6,929,036.00 (666,642,555)	
イギリス・ボン	UK TSY GILT	800,000.00	664,712.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,425,885.00	

ト

UKT 0.125 01/31/28	500,000.00	461,670.00	
UKT 0.25 01/31/25	700,000.00	673,988.00	
UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	1,128,881.00	
UKT 0.375 10/22/26	400,000.00	378,552.00	
UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,612,350.00	
UKT 0.5 01/31/29	700,000.00	647,962.00	
UKT 0.5 10/22/61	100,000.00	54,757.00	
UKT 0.625 06/07/25	500,000.00	486,455.00	
UKT 0.625 07/31/35	400,000.00	326,964.00	
UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	473,045.00	
UKT 1 01/31/32	1,000,000.00	920,570.00	
UKT 1 04/22/24	800,000.00	790,464.00	
UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	201,354.00	
UKT 1.25 07/22/27	200,000.00	196,760.00	
UKT 1.25 07/31/51	500,000.00	380,045.00	
UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,093,741.00	
UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,643,420.00	
UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	902,412.00	
UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	417,485.00	
UKT 1.75 01/22/49	1,250,000.00	1,086,200.00	
UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	92,756.00	
UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,111,330.00	
UKT 2.25 09/07/23	2,700,000.00	2,713,770.00	
UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,702,416.00	
UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	919,116.00	
UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,804,160.00	
UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,466,925.00	
UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,749,865.00	
UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,547,196.00	
UKT 4 01/22/60	1,600,000.00	2,275,040.00	
UKT 4.25 03/07/36	900,000.00	1,112,760.00	
UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	606,835.00	
UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	756,804.00	
UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	1,016,766.00	
UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	762,918.00	
UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,981,425.00	
UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	1,219,779.00	
UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	2,437,358.00	
UKT 4.5 09/07/34	1,100,000.00	1,382,469.00	
UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,394,578.50	
UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,420,491.50	
UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,330,810.00	
UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,408,342.00	
UKT 6 12/07/28	650,000.00	820,508.00	

イギリス・ポンド小計		44,950,000.00	49,002,090.00 (7,927,558,120)	
イスラエル・シケル	ILGOV 0.15 07/31/23	4,700,000.00	4,628,090.00	
	ILGOV 1 03/31/30	700,000.00	631,120.00	
	ILGOV 1.5 11/30/23	2,200,000.00	2,188,604.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	1,500,000.00	1,490,970.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	4,000,000.00	4,408,280.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	2,600,000.00	3,016,078.00	
イスラエル・シケル小計		15,700,000.00	16,363,142.00 (639,741,581)	
デンマーク・クローネ	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	1,288,152.00	
	DGB 0.5 11/15/27	7,800,000.00	7,671,612.00	
	DGB 0.5 11/15/29	4,800,000.00	4,640,976.00	
	DGB 1.5 11/15/23	2,700,000.00	2,742,255.00	
	DGB 1.75 11/15/25	3,100,000.00	3,215,537.00	
	DGB 4.5 11/15/39	8,900,000.00	13,065,556.00	
デンマーク・クローネ小計		29,100,000.00	32,624,088.00 (594,737,124)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	4,200,000.00	3,787,812.00	
	NGB 1.5 02/19/26	3,500,000.00	3,359,125.00	
	NGB 1.75 03/13/25	3,000,000.00	2,927,010.00	
	NGB 1.75 09/06/29	4,700,000.00	4,405,921.00	
	NGB 2 04/26/28	7,000,000.00	6,741,980.00	
	NGB 3 03/14/24	2,800,000.00	2,815,204.00	
ノルウェー・クローネ小計		25,200,000.00	24,037,052.00 (329,788,353)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,562,397.00	
	SGB 0.75 11/12/29	5,800,000.00	5,534,418.00	
	SGB 1 11/12/26	5,800,000.00	5,667,702.00	
	SGB 1.5 11/13/23	6,400,000.00	6,385,280.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	5,105,050.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,600,000.00	6,051,576.00	
スウェーデン・クローナ小計		31,300,000.00	32,306,423.00 (421,921,884)	
メキシコ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	32,536,960.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,219,320.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	20,000,000.00	19,048,800.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	12,000,000.00	11,333,160.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,730,820.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000.00	4,607,200.00	
	MBONO 8 12/07/23	21,000,000.00	20,607,720.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	23,000,000.00	22,786,100.00	
MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	38,952,000.00		
メキシコ・ペソ小計		190,000,000.00	183,822,080.00 (1,198,887,607)	

オフショ ア・人民 元	CGB 2.26 02/24/25	22,000,000.00	21,994,500.00	
	CGB 2.47 09/02/24	26,000,000.00	26,135,980.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	8,989,560.00	
	CGB 2.56 10/21/23	11,000,000.00	11,075,130.00	
	CGB 2.69 08/12/26	41,000,000.00	41,352,190.00	
	CGB 2.8 03/24/29	14,000,000.00	14,062,860.00	
	CGB 2.91 10/14/28	14,000,000.00	14,185,220.00	
	CGB 3.02 05/27/31	40,000,000.00	40,702,000.00	
	CGB 3.72 04/12/51	18,000,000.00	19,356,660.00	
オフショア・人民元小計		195,000,000.00	197,854,100.00	(3,892,304,569)
マレーシ ア・リン ギット	MALAYSIA GOVT	700,000.00	703,416.00	
	MALAYSIA GOVT	1,500,000.00	1,513,785.00	
	MALAYSIA GOVT	700,000.00	705,523.00	
	MALAYSIA GOVT	800,000.00	735,056.00	
	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,052,417.00	
	MGS 3.955 09/15/25	4,700,000.00	4,750,572.00	
	MGS 4.498 04/15/30	6,000,000.00	6,232,320.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	6,886,461.00	
マレーシア・リングット小計		26,200,000.00	26,579,550.00	(793,370,330)
ポーラン ド・ズロ チ	POLGB 0.25 10/25/26	7,000,000.00	5,507,250.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,561,680.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	6,500,000.00	4,729,075.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	10,400,000.00	9,512,360.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	1,600,000.00	1,375,632.00	
ポーランド・ズロチ小計		27,300,000.00	22,685,997.00	(650,094,467)
ユーロ	BGB 0 10/22/31	1,300,000.00	1,156,506.00	
	BGB 0.1 06/22/30	200,000.00	184,740.00	
	BGB 0.35 06/22/32	600,000.00	541,566.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	231,732.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,300,000.00	1,304,914.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	235,992.00	
	BGB 0.8 06/22/25	300,000.00	303,069.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	802,816.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,600,000.00	1,595,520.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	894,735.00	
	BGB 1 06/22/26	1,800,000.00	1,826,172.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,276,106.00	
	BGB 1.25 04/22/33	1,100,000.00	1,086,019.00	
	BGB 1.45 06/22/37	400,000.00	382,332.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	593,619.00	
	BGB 1.7 06/22/50	500,000.00	461,125.00	

BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	1,012,570.00	
BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	514,130.00	
BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	522,240.00	
BGB 2.6 06/22/24	1,100,000.00	1,147,201.00	
BGB 3 06/22/34	200,000.00	230,376.00	
BGB 3.75 06/22/45	800,000.00	1,050,800.00	
BGB 4 03/28/32	500,000.00	624,155.00	
BGB 4.25 03/28/41	1,000,000.00	1,350,320.00	
BGB 4.5 03/28/26	700,000.00	799,596.00	
BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,384,050.00	
BGB 5.5 03/28/28	1,100,000.00	1,389,630.00	
BTPS	2,400,000.00	2,333,832.00	
BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,254,019.00	
BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,328,576.00	
BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	953,520.00	
BTPS 0.65 10/15/23	700,000.00	696,766.00	
BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,609,322.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,697,220.00	
BTPS 0.95 06/01/32	1,000,000.00	826,250.00	
BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.00	1,562,418.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	749,832.00	
BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,178,644.00	
BTPS 1.1 04/01/27	1,800,000.00	1,711,422.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	773,624.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	325,156.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	694,890.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,797,516.00	
BTPS 1.5 06/01/25	1,900,000.00	1,889,322.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,185,768.00	
BTPS 1.65 12/01/30	2,200,000.00	2,009,458.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	1,061,640.00	
BTPS 1.85 05/15/24	3,000,000.00	3,028,830.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	1,002,250.00	
BTPS 2 02/01/28	3,900,000.00	3,833,583.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,307,033.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,486,275.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	1,004,230.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	899,865.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	447,000.00	
BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.00	1,032,999.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	755,595.00	
BTPS 2.5 11/15/25	2,100,000.00	2,143,176.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,328,834.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,398,146.50	

BTPS 2.8 03/01/67	600,000.00	509,898.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,000,000.00	1,019,300.00	
BTPS 2.95 09/01/38	600,000.00	577,578.00	
BTPS 3 08/01/29	1,600,000.00	1,640,464.00	
BTPS 3.1 03/01/40	500,000.00	488,660.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,500,000.00	1,493,820.00	
BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	865,385.00	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	1,021,610.00	
BTPS 3.5 03/01/30	3,400,000.00	3,604,170.00	
BTPS 3.75 09/01/24	2,300,000.00	2,410,515.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,194,017.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	2,844,894.00	
BTPS 4.5 03/01/24	1,000,000.00	1,051,910.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,800,000.00	1,966,878.00	
BTPS 4.75 08/01/23	2,500,000.00	2,595,550.00	
BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.00	2,254,860.00	
BTPS 4.75 09/01/44	1,400,000.00	1,710,044.00	
BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,086,430.00	
BTPS 5 08/01/34	2,070,000.00	2,458,663.20	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,205,792.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	2,082,313.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	2,114,120.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,745,842.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	2,067,829.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	487,240.00	
BTPS 9 11/01/23	300,000.00	329,211.00	
DBR 0 02/15/30	1,300,000.00	1,241,253.00	
DBR 0 02/15/32	1,300,000.00	1,209,403.00	
DBR 0 05/15/35	3,600,000.00	3,185,352.00	
DBR 0 08/15/29	1,600,000.00	1,535,040.00	
DBR 0 08/15/30	5,800,000.00	5,505,534.00	
DBR 0 08/15/31	1,500,000.00	1,409,760.00	
DBR 0 08/15/50	2,800,000.00	2,087,428.00	
DBR 0.25 02/15/27	2,300,000.00	2,284,774.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,800,000.00	1,764,252.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,472,835.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,515,700.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,100,000.00	3,120,894.00	
DBR 0.5 02/15/28	2,100,000.00	2,097,711.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,600,000.00	2,605,590.00	
DBR 1 05/15/38	1,000,000.00	993,540.00	
DBR 1 08/15/24	1,300,000.00	1,319,747.00	
DBR 1 08/15/25	1,300,000.00	1,328,158.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,450,000.00	1,512,640.00	

DBR 1.5 05/15/24	2,200,000.00	2,252,712.00	
DBR 1.75 02/15/24	2,200,000.00	2,256,716.00	
DBR 2 08/15/23	400,000.00	407,180.00	
DBR 2.5 07/04/44	2,200,000.00	2,828,408.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,400,000.00	3,140,160.00	
DBR 3.25 07/04/42	700,000.00	979,671.00	
DBR 4 01/04/37	1,800,000.00	2,522,214.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	1,046,563.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,991,312.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	864,828.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	2,320,000.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,256,679.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,274,840.00	
DBR 6.25 01/04/24	1,200,000.00	1,306,896.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	704,735.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,293,070.00	
FRTR 0 02/25/24	1,900,000.00	1,894,300.00	
FRTR 0 02/25/25	3,000,000.00	2,957,730.00	
FRTR 0 02/25/26	3,800,000.00	3,720,542.00	
FRTR 0 03/25/24	4,800,000.00	4,783,152.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,873,381.00	
FRTR 0 05/25/32	500,000.00	440,710.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	4,177,800.00	
FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,545,919.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,677,860.00	
FRTR 0.25 11/25/26	3,200,000.00	3,138,784.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,298,908.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,500,000.00	3,481,695.00	
FRTR 0.5 05/25/29	1,600,000.00	1,552,144.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	56,104.00	
FRTR 0.5 06/25/44	800,000.00	602,064.00	
FRTR 0.75 02/25/28	500,000.00	496,280.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,300,000.00	3,279,276.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	2,203,050.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,500,000.00	3,469,165.00	
FRTR 1 05/25/27	1,800,000.00	1,821,312.00	
FRTR 1 11/25/25	1,000,000.00	1,014,090.00	
FRTR 1.25 05/25/34	2,100,000.00	2,041,998.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	3,539,124.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,550,000.00	2,625,990.00	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	2,185,032.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	749,376.00	
FRTR 1.75 06/25/39	3,200,000.00	3,232,672.00	
FRTR 1.75 11/25/24	2,600,000.00	2,679,742.00	

FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	2,033,540.00	
FRTR 2.25 05/25/24	1,700,000.00	1,759,891.00	
FRTR 2.5 05/25/30	3,500,000.00	3,888,220.00	
FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	4,238,657.50	
FRTR 3.25 05/25/45	1,400,000.00	1,754,718.00	
FRTR 3.5 04/25/26	2,500,000.00	2,764,425.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	2,000,802.80	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	2,101,834.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,647,780.00	
FRTR 4.25 10/25/23	1,000,000.00	1,049,040.00	
FRTR 4.5 04/25/41	2,000,000.00	2,841,400.00	
FRTR 4.75 04/25/35	2,200,000.00	3,019,390.00	
FRTR 5.5 04/25/29	2,350,000.00	3,046,446.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	569,772.00	
FRTR 6 10/25/25	3,000,000.00	3,522,540.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	441,980.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	499,060.00	
IRISH 1 05/15/26	600,000.00	608,070.00	
IRISH 1.1 05/15/29	1,000,000.00	1,005,410.00	
IRISH 1.3 05/15/33	1,000,000.00	980,120.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	506,265.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	449,915.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	302,934.00	
IRISH 2 02/18/45	900,000.00	922,779.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	658,614.00	
IRISH 3.4 03/18/24	500,000.00	524,880.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	901,024.00	
NETHER 0 01/15/24	1,000,000.00	997,370.00	
NETHER 0 01/15/27	800,000.00	778,336.00	
NETHER 0 07/15/30	2,600,000.00	2,416,050.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,400,000.00	1,393,112.00	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	479,600.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,473,492.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,700,000.00	1,695,801.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	401,748.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,498,455.00	
NETHER 2 07/15/24	1,000,000.00	1,033,090.00	
NETHER 2.5 01/15/33	500,000.00	566,515.00	
NETHER 2.75 01/15/47	1,500,000.00	1,935,075.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,831,089.00	
NETHER 4 01/15/37	1,400,000.00	1,889,454.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	879,410.00	
OBL 0 04/05/24	1,300,000.00	1,297,270.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,778,916.00	

OBL 0 04/16/27	3,300,000.00	3,232,713.00	
OBL 0 10/09/26	1,100,000.00	1,081,201.00	
OBL 0 10/10/25	1,800,000.00	1,784,016.00	
OBL 0 10/13/23	1,600,000.00	1,597,520.00	
OBL 0 10/18/24	600,000.00	596,844.00	
RAGB 0 02/20/30	900,000.00	828,684.00	
RAGB 0 02/20/31	900,000.00	810,558.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	533,142.50	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	692,489.00	
RAGB 0.75 02/20/28	700,000.00	693,917.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	705,105.00	
RAGB 0.75 10/20/26	900,000.00	905,904.00	
RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	90,382.50	
RAGB 0.9 02/20/32	300,000.00	288,195.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	1,021,610.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	676,690.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	176,062.00	
RAGB 1.65 10/21/24	800,000.00	821,672.00	
RAGB 1.75 10/20/23	1,000,000.00	1,017,680.00	
RAGB 2.4 05/23/34	900,000.00	992,124.00	
RAGB 3.15 06/20/44	700,000.00	890,351.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	1,081,738.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	397,140.00	
RAGB 4.85 03/15/26	500,000.00	577,410.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,275,900.00	
RFGB 0.25 09/15/40	500,000.00	388,345.00	
RFGB 0.5 04/15/26	800,000.00	795,728.00	
RFGB 0.5 09/15/28	400,000.00	389,672.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	772,016.00	
RFGB 0.75 04/15/31	500,000.00	484,440.00	
RFGB 1.375 04/15/47	300,000.00	284,676.00	
RFGB 2 04/15/24	900,000.00	927,945.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	920,192.00	
RFGB 2.75 07/04/28	400,000.00	443,224.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	330,945.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	491,460.00	
SPGB 0.25 07/30/24	1,400,000.00	1,390,984.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,000,000.00	928,040.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,252,678.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,000,000.00	1,800,920.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,000,000.00	985,970.00	
SPGB 1 10/31/50	300,000.00	211,287.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,700,000.00	1,409,538.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,926,290.00	

SPGB 1.3 10/31/26	3,100,000.00	3,145,911.00	
SPGB 1.4 04/30/28	1,600,000.00	1,618,576.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,600,000.00	1,615,168.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,000,000.00	2,014,200.00	
SPGB 1.45 10/31/27	600,000.00	610,020.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	265,296.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,532,145.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,434,720.00	
SPGB 1.85 07/30/35	2,000,000.00	1,948,660.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,000,000.00	2,077,240.00	
SPGB 1.95 07/30/30	1,700,000.00	1,752,870.00	
SPGB 2.15 10/31/25	2,400,000.00	2,511,384.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	729,911.00	
SPGB 2.7 10/31/48	1,050,000.00	1,106,721.00	
SPGB 2.75 10/31/24	2,100,000.00	2,203,404.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,861,381.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,543,126.00	
SPGB 3.8 04/30/24	1,400,000.00	1,478,792.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,250,000.00	1,572,837.50	
SPGB 4.4 10/31/23	1,000,000.00	1,047,350.00	
SPGB 4.65 07/30/25	1,800,000.00	2,015,946.00	
SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	2,059,890.00	
SPGB 4.8 01/31/24	2,200,000.00	2,339,436.00	
SPGB 4.9 07/30/40	1,200,000.00	1,668,852.00	
SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,848,450.00	
SPGB 5.15 10/31/44	1,000,000.00	1,488,960.00	
SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,365,480.00	
SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	598,595.00	
SPGB 6 01/31/29	2,200,000.00	2,851,464.00	
ユーロ小計	382,840,000.00	398,804,304.50 (54,133,696,293)	
国債証券合計		156,171,761,017 (156,171,761,017)	
合計		156,171,761,017 (156,171,761,017)	

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

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	203銘柄	50.1%	50.7%
カナダ・ドル	国債証券	22銘柄	2.1%	2.2%
オーストラリア・ドル	国債証券	18銘柄	1.6%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
イギリス・ポンド	国債証券	46銘柄	5.0%	5.1%
イスラエル・シケル	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%

ノルウェー・クローネ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券	9銘柄	0.8%	0.8%
オフショア・人民元	国債証券	9銘柄	2.5%	2.5%
マレーシア・リングギット	国債証券	8銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	5銘柄	0.4%	0.4%
ユーロ	国債証券	265銘柄	34.3%	34.7%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2022年8月1日現在)

資産の部		
流動資産		
預金		51,204,354
金銭信託		462,971
コール・ローン		13,730,545
国債証券		1,581,515,894
派生商品評価勘定		7,721
未収利息		10,022,637
前払費用		6,723,684
流動資産合計		1,663,667,806
資産合計		1,663,667,806
負債の部		
流動負債		
未払解約金		492,022
その他未払費用		35
流動負債合計		492,057
負債合計		492,057
純資産の部		
元本等		
元本		1,811,332,680
剰余金		
剰余金又は欠損金()		148,156,931
元本等合計		1,663,175,749
純資産合計		1,663,175,749
負債純資産合計		1,663,667,806

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適切ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,811,332,680口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 148,156,931円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9182円 (1万口当たりの純資産額9,182円)

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>

<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p>	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年8月1日現在)
----	---------------

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	9,295,300	-	9,303,021	7,721
	小計	9,295,300	-	9,303,021	7,721
合 計		9,295,300	-	9,303,021	7,721

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年8月3日
至 2022年8月1日

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

（その他の注記）

（2022年8月1日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	501,000,000円
同期中における追加設定元本額	1,708,614,570円
同期中における一部解約元本額	398,281,890円
2022年8月1日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）	522,029,546円
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）	985,319,626円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	10,056,556円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	59,433,759円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	135,076,724円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	99,416,469円
合 計	1,811,332,680円

（3）附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリ カ・ドル	ADGB 1.875 09/15/31	800,000.00	714,344.00	
		ADGB 3.125 09/30/49	300,000.00	250,605.00	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	500,000.00	449,965.00	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	200,000.00	150,796.00	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	200,000.00	175,078.00	
		CHILE 2.55 07/27/33	200,000.00	170,278.00	
		CHILE 2.75 01/31/27	200,000.00	190,734.00	
		CHILE 4.34 03/07/42	400,000.00	368,800.00	
		CHINA (PEOPLE'S)	200,000.00	177,672.00	
		CHINA 1.25 10/26/26	200,000.00	188,704.00	
		COLOM 3.125 04/15/31	400,000.00	316,256.00	
		COLOM 5 06/15/45	400,000.00	292,084.00	
		COLOM 5.2 05/15/49	200,000.00	148,046.00	
		DOMREP 6 02/22/33	500,000.00	455,275.00	
		INDON 3.05 03/12/51	200,000.00	161,662.00	
		INDON 4.75 01/08/26	200,000.00	204,890.00	
		INDON 5.125 01/15/45	200,000.00	201,128.00	
		KSA 2.25 02/02/33	1,400,000.00	1,236,172.00	

MEX 2.659 05/24/31	1,000,000.00	857,560.00	
MEX 5 04/27/51	400,000.00	351,268.00	
OMAN 6.25 01/25/31	600,000.00	599,106.00	
PANAMA 2.252 09/29/32	600,000.00	480,006.00	
PERU 2.783 01/23/31	200,000.00	176,662.00	
PERU 5.625 11/18/50	200,000.00	219,362.00	
PHILIP 1.648 06/10/31	200,000.00	168,596.00	
PHILIP 2.95 05/05/45	200,000.00	155,646.00	
PHILIP 3.7 02/02/42	200,000.00	181,404.00	
QATAR 3.75 04/16/30	1,100,000.00	1,129,172.00	
SOAF 4.85 09/30/29	400,000.00	368,304.00	
SOAF 5.875 06/22/30	400,000.00	389,212.00	
TURKEY 6.125 10/24/28	500,000.00	399,210.00	
TURKEY 6.375 10/14/25	400,000.00	361,028.00	
URUGUA 4.375 01/23/31	200,000.00	210,124.00	
アメリカ・ドル小計	13,300,000.00	11,899,149.00 (1,581,515,894)	
国債証券合計		1,581,515,894 (1,581,515,894)	
合 計		1,581,515,894 (1,581,515,894)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 33銘柄	95.1%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2022年8月1日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,274,679
コール・ローン	97,118,620
投資証券	9,697,498,150
派生商品評価勘定	697,600
未収配当金	81,076,278
差入委託証拠金	2,340,000
流動資産合計	9,882,005,327
資産合計	9,882,005,327

負債の部	
流動負債	
前受金	432,000
未払金	63,731,232
未払解約金	983,104
その他未払費用	212
流動負債合計	65,146,548
負債合計	65,146,548
純資産の部	
元本等	
元本	3,565,754,685
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,251,104,094
元本等合計	9,816,858,779
純資産合計	9,816,858,779
負債純資産合計	9,882,005,327

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	3,565,754,685口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.7531円 (1万口当たりの純資産額27,531円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0409月	39,772,400	-	40,470,000	697,600
	小計	39,772,400	-	40,470,000	697,600
	合 計	39,772,400	-	40,470,000	697,600

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年8月1日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,972,759,074円
同期中における追加設定元本額	2,351,598,414円
同期中における一部解約元本額	1,758,602,803円
2022年8月1日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	133,854,085円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	231,503,548円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	149,306,254円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,081,538,683円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,139,674円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	57,002,092円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	41,895,518円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	143,540,085円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	79,844,882円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	63,830,695円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	27,101,211円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,900,184円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	76,648,907円
日興FWS・Jリートインデックス	240,117,405円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	10,094,946円

SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,614,084円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	40,120,307円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	28,840,499円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	36,700,135円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	103,161,491円
合計	3,565,754,685円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	174	20,706,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	275	27,720,000	
	S O S I L A物流リート投資法人	401	61,874,300	
	東海道リート投資法人	103	12,802,900	
	日本アコモデーションファンド投資法人	297	206,712,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,008	156,744,000	
	産業ファンド投資法人	1,283	239,407,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	858	317,031,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	616	136,813,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	453	191,392,500	
	GLP投資法人	2,643	467,811,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	400	135,600,000	
	日本プロロジスリート投資法人	1,406	491,397,000	
	星野リゾート・リート投資法人	150	97,500,000	
	Oneリート投資法人	148	40,907,200	
	イオンリート投資法人	948	146,371,200	
	ヒューリックリート投資法人	803	135,546,400	
	日本リート投資法人	278	105,362,000	
	積水ハウス・リート投資法人	2,610	218,718,000	
	トーセイ・リート投資法人	189	26,176,500	
ケネディクス商業リート投資法人	360	102,276,000		
ヘルスケア&メディカル投資法人	209	35,655,400		
サムティ・レジデンシャル投資法人	216	26,762,400		
野村不動産マスターファンド投資法人	2,775	469,252,500		
いちごホテルリート投資法人	138	13,054,800		

ラサールロジポート投資法人	1,051	184,976,000	
スターアジア不動産投資法人	997	59,122,100	
マリモ地方創生リート投資法人	106	14,331,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	338	177,450,000	
大江戸温泉リート投資法人	132	9,068,400	
投資法人みらい	1,045	53,086,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	198	25,502,400	
三菱地所物流リート投資法人	265	127,730,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	331	68,086,700	
ザイマックス・リート投資法人	137	17,755,200	
タカラレーベン不動産投資法人	335	38,692,500	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	332	50,995,200	
日本ビルファンド投資法人	1,001	708,708,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	857	558,764,000	
日本都市ファンド投資法人	4,329	470,562,300	
オリックス不動産投資法人	1,710	327,636,000	
日本プライムリアルティ投資法人	586	241,725,000	
N T T 都市開発リート投資法人	826	126,708,400	
東急リアル・エステート投資法人	576	112,320,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	589	65,202,300	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,932	283,617,600	
森トラスト総合リート投資法人	613	90,356,200	
インヴィンシブル投資法人	3,775	160,248,750	
フロンティア不動産投資法人	318	173,310,000	
平和不動産リート投資法人	587	88,637,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	579	186,438,000	
福岡リート投資法人	443	76,860,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	252	181,944,000	
いちごオフィスリート投資法人	707	60,660,600	
大和証券オフィス投資法人	178	121,574,000	
阪急阪神リート投資法人	389	60,489,500	
スターツプロシード投資法人	133	34,752,900	
大和ハウスリート投資法人	1,292	416,024,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,766	194,726,400	
大和証券リビング投資法人	1,156	146,349,600	
ジャパンエクセレント投資法人	789	99,492,900	
投資証券 小計		9,697,498,150	
合 計		9,697,498,150	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

(2022年8月1日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	234,050,525
金銭信託	2,124,218
コール・ローン	62,998,874
投資証券	24,139,425,620
派生商品評価勘定	221
未収入金	31,563,597
未収配当金	71,389,068
流動資産合計	24,541,552,123
資産合計	24,541,552,123
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	943,562
その他未払費用	188
流動負債合計	943,750
負債合計	943,750
純資産の部	
元本等	
元本	8,127,619,300
剰余金	
剰余金又は欠損金 ()	16,412,989,073
元本等合計	24,540,608,373
純資産合計	24,540,608,373
負債純資産合計	24,541,552,123

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

	(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,127,619,300口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.0194円 (1万口当たりの純資産額30,194円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等

	<p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年8月1日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	48,300,000	-	47,621,858	678,142
	カナダ・ドル	2,800,000	-	2,754,131	45,869
	オーストラリア・ドル	7,800,000	-	7,615,075	184,925
	シンガポール・ドル	1,500,000	-	1,479,614	20,386
	イギリス・ポンド	1,200,000	-	1,199,965	35
	ユーロ	1,300,000	-	1,285,840	14,160
	小計	62,900,000	-	61,956,483	943,517
	売建				
ユーロ	3,800,000	-	3,799,824	176	
小計	3,800,000	-	3,799,824	176	
合 計		66,700,000	-	65,756,307	943,341

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年8月1日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,669,901,114円
同期中における追加設定元本額	3,371,662,854円
同期中における一部解約元本額	913,944,668円
2022年8月1日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	13,654,762円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	21,394,800円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	14,349,469円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	6,983,627,979円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,899,696円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	52,442,458円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,646,421円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	132,082,932円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	73,446,027円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	57,964,497円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	75,365,482円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	619,904円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	183,494,895円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	72,268,459円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	233,655,802円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	12,367,268円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,885,386円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	33,942,027円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	85,511,036円
合計	8,127,619,300円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	10,182.00	174,417.66	
		AGREE REALTY CORP	9,577.00	762,233.43	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	8,514.00	169,513.74	
		ALEXANDER'S INC	300.00	73,053.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,731.00	3,105,225.18	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	40,420.55	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,000.00	211,610.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	17,614.00	1,150,546.48	

AMERICAN HOMES 4 RENT- A	36,564.00	1,385,044.32	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	33,738.00	1,104,919.50	
APARTMENT INCOME REIT CO	19,660.00	891,384.40	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	15,893.00	132,229.76	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	26,200.00	437,016.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,429.00	119,523.22	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	21,930.80	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	17,500.00	3,743,950.00	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,745.00	98,381.15	
BOSTON PROPERTIES INC	17,847.00	1,626,932.52	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	43,596.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	20,191.00	188,785.85	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	36,449.00	844,887.82	
BROADSTONE NET LEASE INC	19,744.00	447,596.48	
BRT APARTMENTS CORP	500.00	11,495.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,588.00	1,917,266.80	
CARETRUST REIT INC	13,303.00	274,706.95	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	112,321.92	
CEDAR REALTY TRUST INC	2,376.00	69,046.56	
CENTERSPACE	1,542.00	132,442.38	
CHATHAM LODGING TRUST	5,557.00	67,573.12	
CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	64,902.30	
CLIPPER REALTY INC	800.00	7,208.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	125,263.20	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14,223.00	400,377.45	
COUSINS PROPERTIES INC	19,300.00	595,405.00	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	2,658.00	18,738.90	
CTO REALTY GROWTH INC	930.00	19,716.00	
CUBESMART	27,286.00	1,251,608.82	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	26,676.00	247,553.28	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000.00	60,030.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	35,760.00	4,736,412.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	41,319.32	
DOUGLAS EMMETT INC	23,532.00	556,296.48	
DUKE REALTY CORP	47,700.00	2,984,112.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,869.00	240,584.63	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,350.00	912,389.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	181,484.28	
EPR PROPERTIES	8,781.00	472,505.61	
EQUINIX INC	11,400.00	8,022,636.00	
EQUITY COMMONWEALTH	14,758.00	413,961.90	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	21,675.00	1,593,546.00	
EQUITY RESIDENTIAL	42,392.00	3,323,108.88	

ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	15,459.00	372,871.08	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,305.00	2,379,631.65	
EXTRA SPACE STORAGE INC	17,000.00	3,221,840.00	
FARMLAND PARTNERS INC	4,666.00	69,243.44	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,608.00	909,090.88	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17,000.00	883,150.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	9,736.00	284,583.28	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	57,285.85	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	29,431.00	1,530,117.69	
GETTY REALTY CORP	5,036.00	147,756.24	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,102.00	64,986.90	
GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	121,019.04	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,669.00	69,048.42	
GLOBAL NET LEASE INC	13,146.00	198,373.14	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	45,380.00	1,191,225.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	68,819.00	1,901,468.97	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,876.00	28,990.08	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	13,846.00	492,502.22	
HOST HOTELS & RESORTS INC	88,442.00	1,575,152.02	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	260,026.56	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	28,050.00	622,710.00	
INDUS REALTY TRUST INC	823.00	50,268.84	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	62,928.22	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,230.00	311,404.30	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,406.00	241,000.02	
INVITATION HOMES INC	76,600.00	2,989,698.00	
IRON MOUNTAIN INC	35,623.00	1,727,359.27	
JBG SMITH PROPERTIES	12,389.00	315,176.16	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	91,630.00	
KILROY REALTY CORP	13,054.00	707,265.72	
KIMCO REALTY CORP	75,768.00	1,675,230.48	
KITE REALTY GROUP TRUST	28,356.00	564,000.84	
LIFE STORAGE INC	10,858.00	1,366,913.62	
LTC PROPERTIES INC	5,036.00	211,008.40	
LXP INDUSTRIAL TRUST	37,000.00	405,890.00	
MACERICH CO/THE	23,870.00	253,260.70	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	142,622.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	77,231.00	1,331,462.44	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	14,648.00	2,720,573.04	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	22,700.00	1,080,747.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,195.00	559,093.80	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,051.00	392,346.84	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	17,023.00	132,609.17	
NETSTREIT CORP	4,793.00	98,256.50	

NEXPOINT RESIDENTIAL	2,355.00	156,701.70	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,071.00	105,375.38	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	28,957.00	897,667.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	65,268.00	
ORION OFFICE REIT INC	5,199.00	56,877.06	
PARAMOUNT GROUP INC	20,155.00	158,216.75	
PARK HOTELS & RESORTS INC	28,776.00	448,617.84	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15,094.00	295,238.64	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	360.00	1,962.00	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	15,254.00	519,246.16	
PHYSICIANS REALTY TRUST	27,217.00	483,646.09	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,040.00	193,190.40	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774.00	91,947.24	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	24,037.12	
PRIME US REIT	54,200.00	37,940.00	
PROLOGIS INC	92,800.00	12,301,568.00	
PUBLIC STORAGE	19,132.00	6,244,876.12	
REALTY INCOME CORP	75,700.00	5,601,043.00	
REGENCY CENTERS CORP	19,350.00	1,246,720.50	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16,432.00	286,902.72	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	20,534.00	1,343,128.94	
RLJ LODGING TRUST	20,173.00	251,960.77	
RPT REALTY	8,262.00	89,807.94	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6,686.00	591,978.44	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	28,223.00	434,351.97	
SAFEHOLD INC	1,242.00	52,958.88	
SAUL CENTERS INC	2,331.00	121,864.68	
SERVICE PROPERTIES TRUST	26,005.00	170,072.70	
SIMON PROPERTY GROUP INC	41,400.00	4,497,696.00	
SITE CENTERS CORP	20,665.00	301,915.65	
SL GREEN REALTY CORP	8,071.00	400,725.15	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,135.00	759,765.90	
STAG INDUSTRIAL INC	22,400.00	734,272.00	
STORE CAPITAL CORP	32,202.00	934,502.04	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	110,669.30	
SUN COMMUNITIES INC	15,344.00	2,515,802.24	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	29,379.00	332,864.07	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,336.00	249,516.72	
TERRENO REALTY CORP	9,726.00	609,333.90	
UDR INC	37,411.00	1,810,692.40	
UMH PROPERTIES INC	6,284.00	133,912.04	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	72,441.60	
URBAN EDGE PROPERTIES	15,028.00	246,910.04	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,927.00	53,856.80	

	VENTAS INC	49,400.00	2,656,732.00	
	VERIS RESIDENTIAL INC	10,798.00	150,632.10	
	VICI PROPERTIES INC	121,500.00	4,154,085.00	
	VORNADO REALTY TRUST	19,251.00	585,037.89	
	WASHINGTON REIT	10,790.00	239,214.30	
	WELLTOWER INC	57,200.00	4,938,648.00	
	WHITESTONE REIT	4,511.00	50,658.53	
	WP CAREY INC	23,762.00	2,121,946.60	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	15,327.00	251,669.34	
	アメリカ・ドル小計	3,290,095.00	140,628,433.11 (18,690,925,045)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,800.00	300,696.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	112,658.92	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,725.00	35,561.25	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,190.00	155,799.60	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	13,622.00	50,673.84	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,830.00	476,853.30	
	CHOICE PROPERTIES REIT	17,893.00	255,333.11	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	5,107.00	84,725.13	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,551.00	77,367.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	12,411.00	156,626.82	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,169.00	44,312.67	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,377.00	43,118.83	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	14,775.00	230,490.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,563.00	287,819.14	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	16,425.00	221,573.25	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	1,387.00	9,972.53	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	150,053.20	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	145,844.93	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	22,283.80	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	26,375.58	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	44,536.25	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12,305.00	161,810.75	
	PLAZA RETAIL REIT	8,509.00	35,737.80	
	PRIMARIS REIT	6,318.00	83,713.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	19,525.00	401,238.75	
	SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	47,364.72	
SLATE OFFICE REIT	3,663.00	17,179.47		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,440.00	275,836.80		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	13,800.00	257,094.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,770.00	32,292.90		
	カナダ・ドル小計	245,667.00	4,244,943.84 (440,412,923)	
オースト	ABACUS PROPERTY GROUP	50,980.00	149,371.40	

ラリア・ ドル	ARENA REIT	45,981.00	221,168.61	
	BWP TRUST	66,965.00	286,610.20	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	104,758.00	217,896.64	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	266,839.88	
	CENTURIA OFFICE REIT	43,559.00	81,237.53	
	CHARTER HALL GROUP	56,632.00	721,491.68	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,852.00	336,026.60	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	62,449.00	261,036.82	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	37,955.00	143,469.90	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718.00	133,323.12	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	91,013.37	
	DEXUS/AU	130,644.00	1,243,730.88	
	GDI PROPERTY GROUP	43,204.00	42,339.92	
	GOODMAN GROUP	215,000.00	4,450,500.00	
	GPT GROUP	234,641.00	1,067,616.55	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	30,439.00	114,450.64	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	88,682.25	
	HOME CONSORTIUM LTD	33,678.00	180,177.30	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	187,797.00	260,098.84	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	25,921.00	87,612.98	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,965.00	185,437.60	
	MIRVAC GROUP	482,145.00	1,036,611.75	
	NATIONAL STORAGE REIT	129,680.00	320,309.60	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	89,106.00	73,957.98	
	RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	145,032.25	
	SCENTRE GROUP	660,000.00	1,914,000.00	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	143,852.00	425,801.92		
STOCKLAND	297,031.00	1,143,569.35		
VICINITY CENTRES	479,141.00	991,821.87		
WAYPOINT REIT	76,045.00	199,237.90		
オーストラリア・ドル小計		4,218,967.00	16,880,475.33 (1,566,676,915)	
香港・ド ル	CHAMPION REIT	239,000.00	826,940.00	
	FORTUNE REIT	208,000.00	1,393,600.00	
	LINK REIT	262,700.00	17,259,390.00	
	PROSPERITY REIT	178,000.00	427,200.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	110,000.00	412,500.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	230,000.00	701,500.00	
香港・ドル小計		1,227,700.00	21,021,130.00 (355,887,731)	
シンガ ポール・ ドル	AIMS APAC REIT	38,300.00	53,237.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	436,000.00	1,294,920.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	260,055.00	304,264.35	
	CAPITALAND CHINA TRUST	113,900.00	134,402.00	

	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	660,808.00	1,440,561.44	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	94,950.00	125,334.00	
	EC WORLD REIT	52,800.00	28,248.00	
	ESR-LOGOS REIT	606,713.00	254,819.46	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	121,600.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	176,400.00	49,392.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	141,800.00	330,394.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	370,238.00	533,142.72	
	IREIT GLOBAL	57,600.00	34,560.00	
	KEPPEL DC REIT	143,600.00	297,252.00	
	KEPPEL REIT	275,800.00	306,138.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	218,770.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	261,800.00	497,420.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	243,800.00	660,698.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	380,350.00	669,416.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	243,200.00	93,632.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	48,000.00	229,920.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700.00	52,693.00	
	SPH REIT	115,700.00	109,336.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	138,200.00	82,229.00	
	SUNTEC REIT	265,900.00	428,099.00	
	シンガポール・ドル小計	5,644,614.00	8,350,478.47 (803,399,535)	
ニュー ジーラン ド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	107,000.00	139,635.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	123,606.00	269,461.08	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	200,506.00	204,516.12	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	151,115.00	214,583.30	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	57,519.00	163,066.36	
	ニュージーランド・ドル小計	639,746.00	991,261.86 (82,859,579)	
イギリ ス・ポン ド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	42,037.92	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	10,746.00	
	ASSURA PLC	378,833.00	260,258.27	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	89,651.00	107,401.89	
	BIG YELLOW GROUP PLC	20,546.00	292,780.50	
	BRITISH LAND CO PLC	118,763.00	584,313.96	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	125,000.00	185,875.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	108,964.00	90,222.19	
	CUSTODIAN REIT PLC	39,999.00	43,518.91	
	DERWENT LONDON PLC	13,796.00	395,669.28	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	60,037.00	54,033.30	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	30,485.00	188,854.57	
	HAMMERSON PLC	440,241.00	109,620.00	
HOME REIT PLC	96,051.00	114,300.69		

	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	41,816.00	49,175.61	
	INTU PROPERTIES PLC	28,500.00	285.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	91,942.00	672,279.90	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	118,804.00	297,485.21	
	LXI REIT PLC	231,365.00	343,345.66	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	40,360.41	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141.00	52,798.28	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	182,000.00	268,632.00	
	PRS REIT PLC/THE	89,207.00	98,127.70	
	REGIONAL REIT LTD	45,664.00	33,700.03	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	25,924.00	295,533.60	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	38,247.61	
	SEGro PLC	150,500.00	1,647,975.00	
	SHAFTESBURY PLC	36,339.00	182,421.78	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	149,811.00	193,256.19	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	32,405.64	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	236,658.00	466,689.57	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847.00	90,506.49	
	UNITE GROUP PLC/THE	47,953.00	558,652.45	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	118,733.75	
	イギリス・ポンド小計	3,407,816.00	7,960,244.36 (1,287,808,334)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	21,722.00	434,440.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	25,500.00	257,550.00	
	イスラエル・シュケル小計	47,222.00	691,990.00 (27,054,387)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	28,733,750.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	124,560,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,067.00	20,863,710.00	
	JR REIT XXVII	19,000.00	89,300,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	6,226.00	35,176,900.00	
	LOTTE REIT CO LTD	12,522.00	63,611,760.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	9,815.00	43,578,600.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,302.00	41,408,620.00	
	SK REITS CO LTD	12,831.00	68,389,230.00	
	SK REITS CO LTD-RIGHTS	3,437.00	123,732.00	
	韓国・ウォン小計	103,550.00	515,746,302.00 (52,451,399)	
ユーロ	AEDIFICA	4,810.00	487,734.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,760.00	21,260.80	
	ALTAREA	506.00	73,268.80	
	BEFIMMO	519.00	24,600.60	
	CARE PROPERTY INVEST	3,490.00	84,458.00	
	CARMILA	7,172.00	110,879.12	

	COFINIMMO	4,000.00	439,200.00	
	COVIVIO	5,703.00	351,589.95	
	CROMWELL REIT EUR	48,320.00	96,640.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4,841.00	106,792.46	
	GECINA SA	6,658.00	665,800.00	
	HAMBORNER REIT AG	11,000.00	94,600.00	
	ICADE	3,844.00	187,817.84	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,798.00	17,416.74	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	32,858.00	212,426.97	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3,500.00	96,950.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	52,815.00	71,511.51	
	KLEPIERRE	25,069.00	542,743.85	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940.00	33,207.90	
	MERCIALYS	6,257.00	54,123.05	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	42,596.00	445,980.12	
	MONTEA NV	1,234.00	122,042.60	
	NSI NV	2,336.00	74,051.20	
	RETAIL ESTATES	1,586.00	109,275.40	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	14,546.00	802,793.74	
	VASTNED RETAIL NV	2,035.00	48,229.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	17,118.00	567,632.88	
	WERELDHAVE NV	5,522.00	81,615.16	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,441.00	104,352.75	
	ユーロ小計	324,274.00	6,128,994.94 (831,949,773)	
	投資証券合計		24,139,425,620 (24,139,425,620)	
	合計		24,139,425,620 (24,139,425,620)	

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 149銘柄	76.2%	77.4%
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	1.8%	1.8%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	6.4%	6.5%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	1.5%	1.5%
シンガポール・ドル	投資証券 25銘柄	3.3%	3.3%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	0.3%	0.3%
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	5.2%	5.3%
イスラエル・シケル	投資証券 2銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	投資証券 10銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券 29銘柄	3.4%	3.4%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

ゴールド・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

(2022年8月1日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	50,835,829
金銭信託	801,380
コール・ローン	23,766,874
投資信託受益証券	2,222,149,257
派生商品評価勘定	80
流動資産合計	2,297,553,420
資産合計	2,297,553,420
負債の部	
流動負債	
未払金	49,525,323
未払解約金	1,754,080
その他未払費用	62
流動負債合計	51,279,465
負債合計	51,279,465
純資産の部	
元本等	
元本	1,959,291,365
剰余金	
剰余金又は欠損金 ()	286,982,590
元本等合計	2,246,273,955
純資産合計	2,246,273,955
負債純資産合計	2,297,553,420

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年8月1日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,959,291,365口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1465円 (1万口当たりの純資産額11,465円)

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

	<p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年8月1日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（2022年8月1日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	13,289,950	-	13,290,030	80
	小計	13,289,950	-	13,290,030	80
合 計		13,289,950	-	13,290,030	80

（注）1．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2021年8月3日 至 2022年8月1日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2022年8月1日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,900,000円
同期中における追加設定元本額	2,125,454,474円
同期中における一部解約元本額	168,063,109円
2022年8月1日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）	319,364,303円
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）	1,447,011,797円

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)	192,915,265円
合計	1,959,291,365円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES GOLD TRUST	143,640.00	4,804,758.00	
		SPDR GOLD MINISHARES TRUST	340,510.00	11,914,444.90	
	アメリカ・ドル小計		484,150.00	16,719,202.90	(2,222,149,257)
投資信託受益証券合計				2,222,149,257	(2,222,149,257)
合計				2,222,149,257	(2,222,149,257)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	98.9%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

日興FWS・日本株インデックス

2022年7月29日現在

資産総額	2,747,964,146円
負債総額	1,219,829円
純資産総額（ - ）	2,746,744,317円
発行済口数	2,697,917,512口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.0181円 (10,181円)

日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）

2022年7月29日現在

資産総額	1,222,691,930円
負債総額	2,152,232円
純資産総額（ - ）	1,220,539,698円
発行済口数	1,349,940,370口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.9041円 (9,041円)

日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）

2022年7月29日現在

資産総額	4,851,490,599円
負債総額	2,114,945円
純資産総額（ - ）	4,849,375,654円
発行済口数	4,421,356,569口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.0968円 (10,968円)

日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）

2022年7月29日現在

資産総額	797,865,197円
負債総額	817,521円
純資産総額（ - ）	797,047,676円
発行済口数	1,017,482,687口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.7834円 (7,834円)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

2022年7月29日現在

資産総額	1,605,043,642円
負債総額	3,615,952円
純資産総額(-)	1,601,427,690円
発行済口数	1,639,222,551口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	0.9769円 (9,769円)

日興FWS・日本債インデックス

2022年7月29日現在

資産総額	4,078,379,872円
負債総額	1,773,102円
純資産総額(-)	4,076,606,770円
発行済口数	4,199,724,418口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	0.9707円 (9,707円)

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

資産総額	695,140,182円
負債総額	415,468円
純資産総額(-)	694,724,714円
発行済口数	782,356,858口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	0.8880円 (8,880円)

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

2022年7月29日現在

資産総額	599,198,515円
負債総額	283,525円
純資産総額(-)	598,914,990円
発行済口数	584,627,729口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0244円 (10,244円)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

資産総額	494,174,618円
負債総額	488,460円

純資産総額(-)	493,686,158円
発行済口数	673,447,896口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	0.7331円 (7,331円)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

2022年7月29日現在

資産総額	902,980,226円
負債総額	1,852,354円
純資産総額(-)	901,127,872円
発行済口数	989,524,206口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	0.9107円 (9,107円)

日興FWS・Jリートインデックス

2022年7月29日現在

資産総額	652,808,054円
負債総額	355,699円
純資産総額(-)	652,452,355円
発行済口数	673,529,476口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	0.9687円 (9,687円)

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

2022年7月29日現在

資産総額	220,651,068円
負債総額	491,206円
純資産総額(-)	220,159,862円
発行済口数	235,633,396口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	0.9343円 (9,343円)

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

2022年7月29日現在

資産総額	701,659,752円
負債総額	401,009円
純資産総額(-)	701,258,743円
発行済口数	611,498,174口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.1468円 (11,468円)

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）

2022年7月29日現在

資産総額	378,568,249円
負債総額	917,732円
純資産総額（ - ）	377,650,517円
発行済口数	408,970,801口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.9234円 (9,234円)

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）

2022年7月29日現在

資産総額	1,664,789,555円
負債総額	1,718,985円
純資産総額（ - ）	1,663,070,570円
発行済口数	1,438,254,887口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.1563円 (11,563円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記aの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記aの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したと

きは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2022年7月29日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

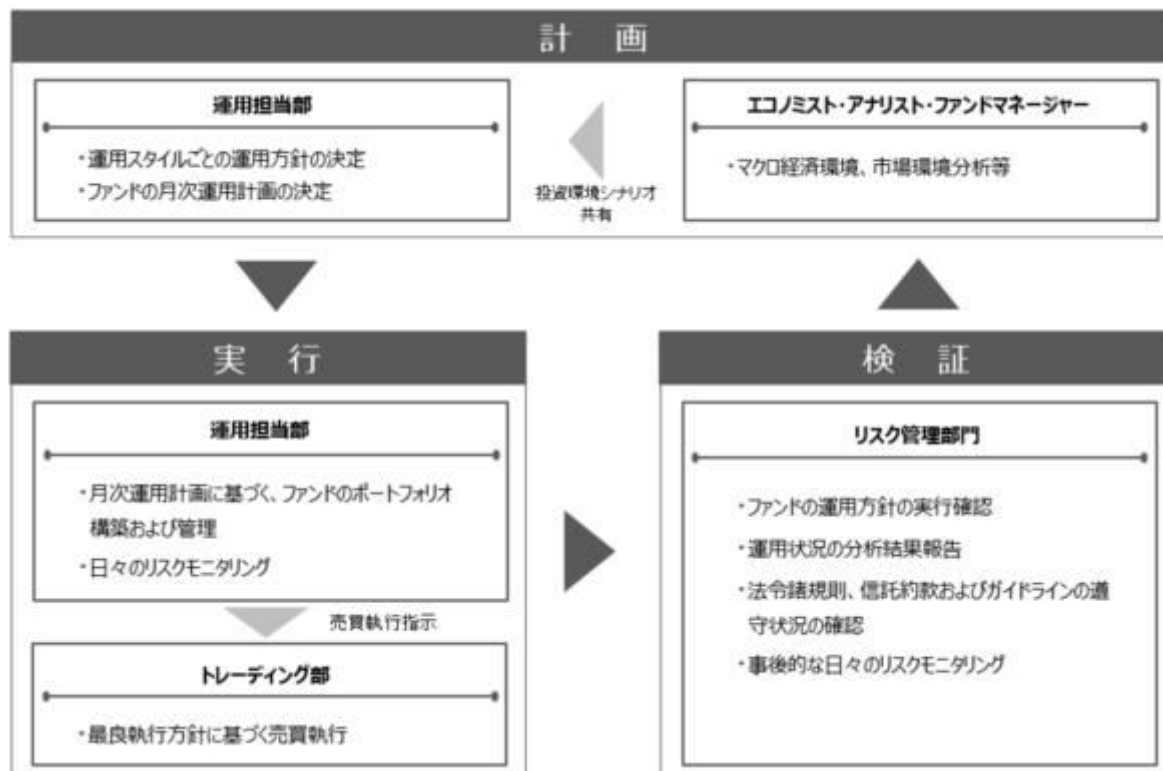
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2022年7月29日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	722	9,330,701
単位型株式投資信託	97	471,309
追加型公社債投資信託	1	25,612
単位型公社債投資信託	186	357,415
合計	1,006	10,185,039

3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度（2021年4月1日から2022年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	33,048,142	49,008,279
顧客分別金信託	300,036	300,041
前払費用	449,748	475,266
未収入金	132,419	103,809
未収委託者報酬	9,936,096	12,125,117
未収運用受託報酬	2,247,156	2,437,063
未収投資助言報酬	398,108	388,639
未収収益	39,975	36,700
その他の流動資産	6,981	18,458
流動資産合計	46,558,665	64,893,375
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	1,509,450	1,433,442
器具備品	870,855	653,985
土地	710	710
リース資産	13,483	7,357

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

(単位：千円)

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

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

(2) 【損益計算書】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	50,610,457	66,139,024
運用受託報酬	9,450,169	9,652,634
投資助言報酬	1,270,584	1,256,334
その他営業収益		
サービス支 hands 手数料	200,807	199,046
その他	32,820	32,936
営業収益計	61,564,839	77,279,976
営業費用		
支払手数料	22,784,919	30,522,133
広告宣伝費	365,317	330,161
調査費		
調査費	3,061,987	3,196,921
委託調査費	7,810,157	12,192,048
営業雑経費		
通信費	95,163	67,600
印刷費	554,920	494,834
協会費	40,044	34,433
諸会費	29,473	30,488
情報機器関連費	4,562,612	4,767,504
販売促進費	23,614	31,930
その他	163,332	181,301
営業費用合計	39,491,542	51,849,358
一般管理費		
給料		
役員報酬	277,027	263,893
給料・手当	9,280,730	8,664,828
賞与	950,630	991,916
賞与引当金繰入額	1,501,855	2,100,323
交際費	11,815	12,301
寄付金	949	29,273
事務委託費	844,255	1,422,189
旅費交通費	21,023	16,863

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

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月 31日)	当事業年度 (自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月 31日)
営業外収益		
受取配当金	13,164	7,666
受取利息	2,736	1,836
時効成立分配金・償還金	88,335	43,406
原稿・講演料	2,603	2,587
投資有価証券償還益	57,388	383,608
投資有価証券売却益	162,941	911,268
為替差益	-	4,673
雑収入	72,933	81,640
営業外収益合計	400,104	1,436,686
営業外費用		
投資有価証券償還損	11,762	146,219
投資有価証券売却損	34,473	81,384
為替差損	766	-
雑損失	1,240	2,866
営業外費用合計	48,243	230,470
経常利益	422,288	7,041,212
特別損失		
固定資産除却損	1 54,493	83,651
減損損失	2 28,097,346	-
システム統合関連費用	3 -	375,636
早期退職費用	4 216,200	260,075
本社移転費用	127,044	-
その他特別損失	5,460	67,000
特別損失合計	28,500,544	786,362
税引前当期純利益又は 税引前当期純損失()	28,078,256	6,254,849
法人税、住民税及び事業税	1,549,173	3,101,482
法人税等調整額	693,192	965,673
法人税等合計	855,980	2,135,809
当期純利益又は 当期純損失()	28,934,237	4,119,040

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

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

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:千円)

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

	株主資本	評価・換算差額等
--	------	----------

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 4～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年（社内における利用可能期間）

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。)等を適用しており、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び収益を認識する通常の時点は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

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

(2) 運用受託報酬

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

(3) 投資助言報酬

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

(会計方針の変更)

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物	102,329千円	210,548千円
器具備品	1,153,649千円	1,309,352千円
リース資産	2,830千円	6,073千円

2 当座借越契約

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

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

3 保証債務

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

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

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

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
建物	18,278千円	- 千円
器具備品	28,604千円	0千円
リース資産	- 千円	- 千円
ソフトウェア	7,610千円	83,651千円
ソフトウェア仮勘定	- 千円	- 千円

2 減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位：千円)

場所	用途	種類	減損損失
-	その他	のれん	28,097,346

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

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

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

3 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

4 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

2.剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

2.剰余金の配当に関する事項

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

市場リスクの管理

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

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2021年3月31日）

(単位：千円)

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

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

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:千円)

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

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

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

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

(注2)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

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

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

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

また時価をもって貸借対照表計上額としている「(6) その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」第26項の経過措置を適用し、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項は記載しておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	33,048,142	-	-	-
顧客分別金信託	300,036	-	-	-
未収委託者報酬	9,936,096	-	-	-
未収運用受託報酬	2,247,156	-	-	-
未収投資助言報酬	398,108	-	-	-
長期差入保証金	42,007	1,367,084	-	-
合計	45,971,548	1,367,084	-	-

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
----	------	---------	----------	------

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度（2021年3月31日）

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）

(単位：千円)

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

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

当事業年度（2022年3月31日）

(単位：千円)

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	5,299,814	5,258,448
勤務費用	476,308	454,611
利息費用	-	1,013
数理計算上の差異の発生額	67,476	34,553
退職給付の支払額	585,151	595,013
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	5,258,448	5,084,506

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	476,308	454,611
利息費用	-	1,013
数理計算上の差異の費用処理額	67,476	34,553
その他	246,359	211,487
確定給付制度に係る退職給付費用	790,144	632,559

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	0.020%	0.130%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度239,162千円、当事業年度237,296千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

前事業年度 当事業年度

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

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

(収益認識関係)

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

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2021年4月1日 至2022年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の 子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,728,851	未払 手数料	863,159
親会社の 子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,578,226	未払 手数料	1,070,559

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の 子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	4,727,024	未払 手数料	1,098,966
親会社の 子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	8,397,864	未払 手数料	1,661,614

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	2,510.93円	2,613.28円
1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失()	854.27円	121.61円

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

当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり当期純利益又は当期純損失		
当期純利益又は当期純損失()(千円)	28,934,237	4,119,040
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失()(千円)	28,934,237	4,119,040
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

4【利害関係人との取引制限】

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

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
 - (イ) 定款の変更
該当ありません。
 - (ロ) その他の重要事項
該当ありません。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- イ 受託会社
 - (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
 - (ロ) 資本金の額 342,037百万円(2022年3月末現在)
 - (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

[参考情報：再信託受託会社の概要]

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2022年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

□ 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2022年3月末現在	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2022年 4月27日	有価証券届出書の訂正届出書
2022年 4月27日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2022年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・日本株インデックスの2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・日本株インデックスの2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・日本債インデックスの2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・日本債インデックスの2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石井 勝也

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石井 勝也

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

松井 貴志

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・Jリートインデックスの2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・Jリートインデックスの2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石井 勝也

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石井 勝也指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）の2021年8月3日から2022年8月1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、日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）の2022年8月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。