

【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11月22日提出
【計算期間】	第5期(自 2021年8月21日至 2022年8月22日)
【ファンド名】	グローバル経済コア
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ
ないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに
運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産
を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産
を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉と
する旨の記載があるものをいう。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉
とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉
とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質
的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする
旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記
(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、
その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産に
よる投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定
する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場
証券投資信託をいう。

[補足分類]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の
記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われ
る特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊
型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記す
るものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるも
のとする。

< 属性区分表定義 >

〔投資対象資産による属性区分〕

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

〔決算頻度による属性区分〕

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

〔投資対象地域による属性区分(重複使用可能)〕

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

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

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とす

る旨の記載があるものをいう。

- (4) 欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5) アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6) オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1) ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2) ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1) 為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2) 為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

- (1) ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4) その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

< ファンドの特色 >

1. 世界の幅広い資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 日本を含む世界*の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、債券、及び不動産投資信託証券(REIT)、並びに金に分散投資します。
※REITは新興国を含みません。
※コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。
- 各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数(インデックス)*への連動を目指す運用を行います。

各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは後掲「2 投資方針 (2)投資対象 (参考)マザーファンドの概要」をご覧ください。

- 「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
※「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」は、金現物市場の代表的な指数への連動を目指す上場投資信託証券に投資を行うとともに、組入外貨建資産については対円での為替ヘッジを行います。株式などの主要資産が下落する局面では、金(為替ヘッジあり)にも投資することでリスクの低減を図ります。



? ファミリーファンド方式とは

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

? DR(預託証券)とは

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

2. 世界経済全体の発展を享受します。

- 株式及び債券を投資対象とする各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定します。

基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率

資産	基本資産配分比率 (変動幅) ^{*1, *2}	投資するマザーファンド	各マザーファンド受益証券の 基本組入比率 ^{*2}
株式	37.5% (35.0%~40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP(国内総生産)総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比(日本、先進国、新興国の比率)を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 ^{*3}
		外国株式インデックス マザーファンド	
		新興国株式インデックス マザーファンド	
債券	37.5% (35.0%~40.0%)	国内債券インデックス マザーファンド	
		外国債券インデックス マザーファンド	
		新興国債券インデックス マザーファンド	
REIT	10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5.0%
		グローバルREITインデックス マザーファンド	5.0%
金	15.0% (10.0%~20.0%)	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	基本資産配分比率で決定した比率(10.0%~20.0%)の通り。 ^{*4}

※1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。

※2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。

※3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。

※4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャルペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。

ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各資産のマザーファンド受益証券へ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※基本資産配分比率は、市場動向等に応じて変動幅の範囲で変更する場合があります。

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。

ただし、分配を行わないことがあります。

- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

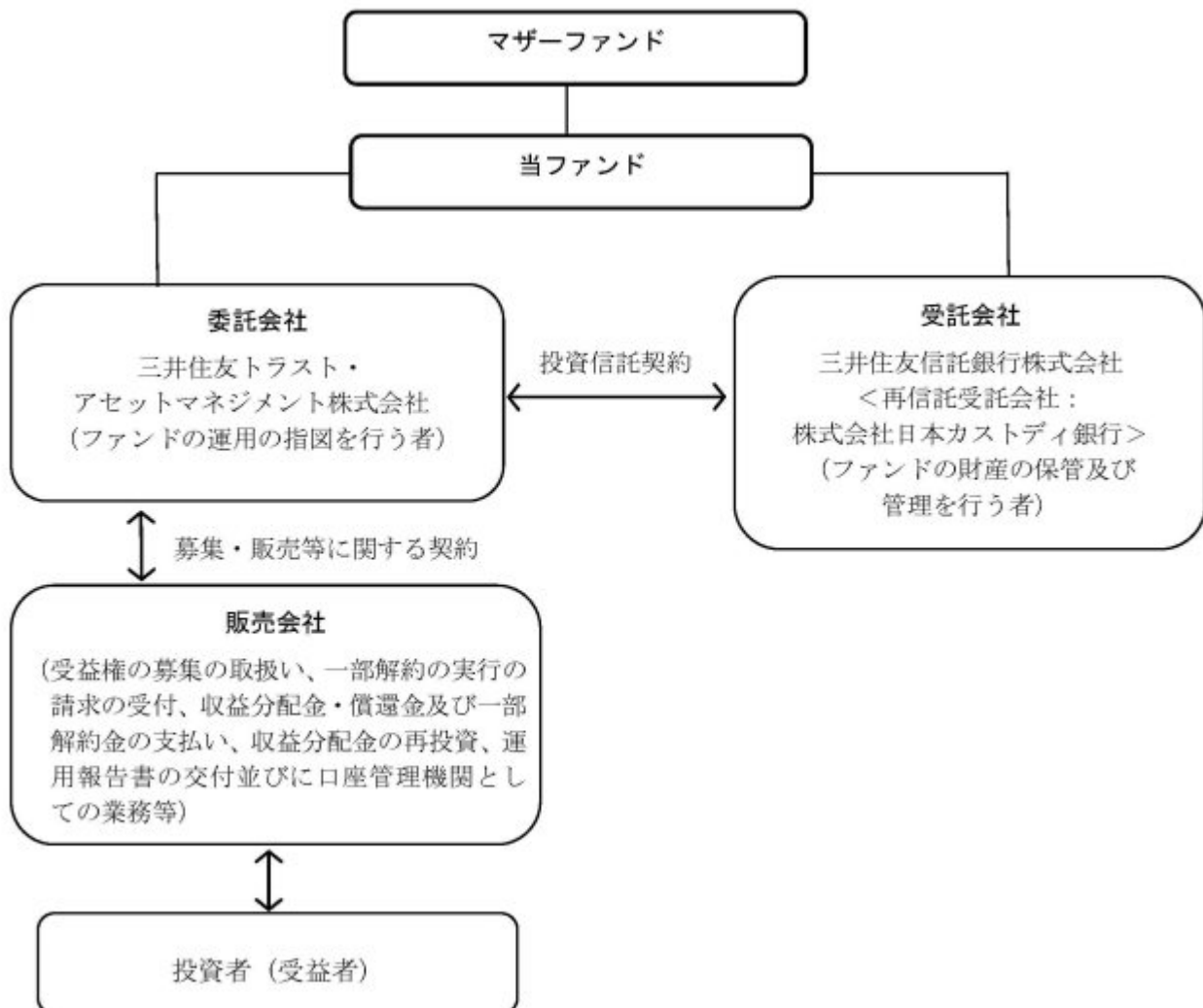
(2) 【ファンドの沿革】

2017年11月30日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2022年 9月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
-----	----	-----	------

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREIT インデックス マザーファンド」及び「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」（以下総称して「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。

投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券、及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）、並びに金現物市場の代表的指数への連動を目指す上場投資信託証券（以下「金」という場合があります。）に実質的に分散投資します。

REITは新興国を含みません。

ロ．基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、以下の通りとします。

基本資産配分比率 （変動幅） ^{1 2}	投資対象マザーファンド	各マザーファンド受益証券 の基本組入比率 ²
<株式> 37.5% (35.0~40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比（日本、先進国、新興国の比率）を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 ³
	外国株式インデックス マザーファンド	
	新興国株式インデックス マザーファンド	
<債券> 37.5% (35.0~40.0%)	国内債券インデックス マザーファンド	5%
	外国債券インデックス マザーファンド	
	新興国債券インデックス マザーファンド	
<REIT> 10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5%
	グローバルREITインデックス マザーファンド	5%
<金> 15.0% (10.0~20.0%)	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	基本資産配分比率で決定した比率（10.0~20.0%）の通り。 ⁴

- 1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。
 - 2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。
 - 3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。
 - 4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。
- ハ．「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ニ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
1. 有価証券
 2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限り。）
 3. 金銭債権
 4. 約束手形
- ロ．次に掲げる特定資産以外の資産
1. 為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」及び「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証券
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が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商

品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

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

12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの

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

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

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

16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

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. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

（参考）マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）¹と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)に上場している株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引(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。以下同じ。)、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。以下同じ。)、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。以下同じ。)を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合²と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引及び金利先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

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

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目指して、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）³ に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）⁴と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

調整を行うこととします。

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

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

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）⁵に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）⁶に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）⁷の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

※7「東証REIT指数(配当込み)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）⁸の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

※8 「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's[®]及びS&P[®]は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいづれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。

「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

<別に定める金現物に投資する上場投資信託証券>（2022年 9月30日現在）

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

(2)投資態度

主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）⁹（「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。

投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。

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

3. 運用制限

株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

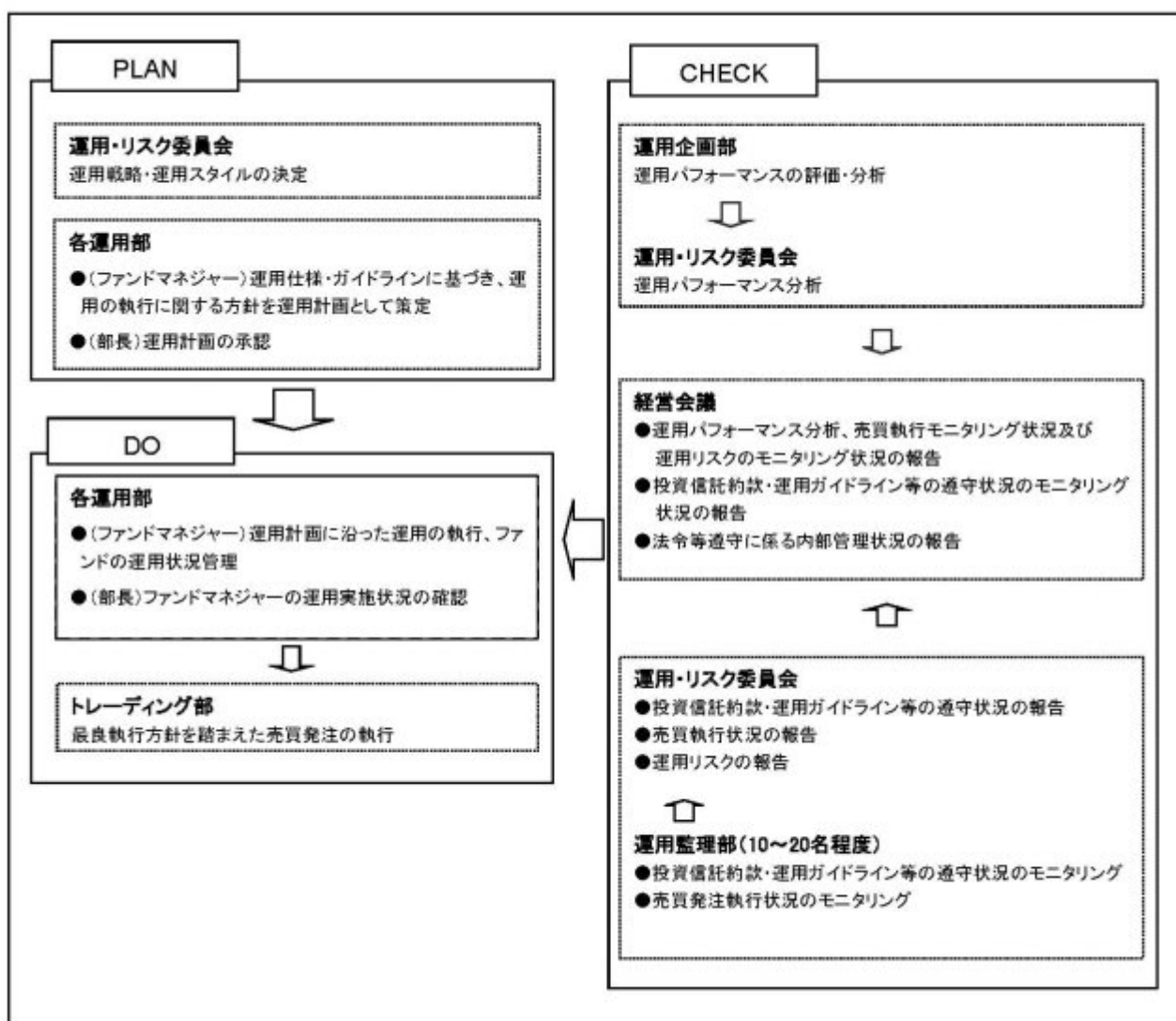
9 金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）とはLBMA金価格（円ヘッジベース）です（2022年9月30日現在）。

LBMA金価格の正式名称はLBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド

（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後公表される1トロイオンスあたりの金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会（London Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

（3）【運用体制】

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



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

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを

行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

（４）【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．投資する株式等の範囲

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

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

ホ．信用取引の指図範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

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

めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

へ. 先物取引等の運用指図、目的及び範囲

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

ト. スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

チ. 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

リ. 有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(八) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとしします。

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとしします。

(ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとしします。

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

(ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとしします。

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとしします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

(ニ) 上記(ロ)においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

カ．資金の借入れ

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

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

(投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則)

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して

円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

なお、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」における外貨建資産については、原則として為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図ることを基本としますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

金利変動リスク

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

商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

リートの価格変動リスク

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

信用リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドは中長期的な成長を目指して、市場環境等の変化や見通しに応じた運用を行うため、委託会社の判断で投資対象とする資産の投資割合を変更します。この投資割合の変更が、ファンドの収益の増加に寄与する場合がありますが、収益の減少や損失の発生の要因となる場合があります。

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落するこ

とになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*当ファンドについては2018年11月～2022年9月の3年11ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2017年10月～2022年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。

従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケットベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は債権は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利ノウハウ及び同指数に係る権利又は債権に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、JPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコフサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコフサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI Emerging Markets インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動サービスに限り一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき同責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Global Bond Index Emerging Markets インデックス (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は英語を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.935%（税抜0.85%）を乗じて得た額とします（信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.44% （税抜 0.4%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.44% （税抜 0.4%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（4）【その他の手数料等】

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

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」について」をご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2022年9月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2022年9月30日現在の状況について記載してあります。

【グローバル経済コア】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	10,643,676,878	99.07
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		99,859,612	0.93
合計（純資産総額）		10,743,536,490	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	855,775,731	3.1620	2,706,032,707	3.1260	2,675,154,935	24.90
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	640,299,702	4.5231	2,896,191,315	4.1254	2,641,492,390	24.59
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	747,419,405	1.7962	1,342,587,035	1.7904	1,338,179,702	12.46
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	358,666,061	3.6255	1,300,378,406	3.3548	1,203,252,901	11.20
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	872,561,473	1.1960	1,043,648,446	1.1307	986,605,257	9.18
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	237,623,028	2.7102	644,024,038	2.3076	548,338,899	5.10
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	245,660,195	2.2171	544,669,999	2.1427	526,376,099	4.90
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	221,515,214	1.9694	436,265,825	1.8355	406,591,175	3.78
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	233,420,662	1.3778	321,628,838	1.3610	317,685,520	2.96

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.07
合計	99.07

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2018年 8月20日)	13,643,422,697	13,643,422,697	9,632	9,632
第2期計算期間末 (2019年 8月20日)	12,745,858,008	12,745,858,008	10,021	10,021
第3期計算期間末 (2020年 8月20日)	11,044,987,442	11,044,987,442	10,880	10,880
第4期計算期間末 (2021年 8月20日)	10,716,800,292	10,716,800,292	12,281	12,281
第5期計算期間末 (2022年 8月22日)	11,407,002,963	11,407,002,963	12,927	12,927
2021年 9月末日	10,779,314,060		12,322	
10月末日	11,064,028,512		12,763	
11月末日	10,834,472,651		12,540	
12月末日	10,963,807,516		12,828	
2022年 1月末日	10,564,704,016		12,386	
2月末日	10,537,813,449		12,316	
3月末日	11,114,453,900		12,971	
4月末日	10,930,946,703		12,708	
5月末日	10,948,474,499		12,639	
6月末日	10,973,074,506		12,613	
7月末日	11,158,795,291		12,711	
8月末日	11,084,246,757		12,740	
9月末日	10,743,536,490		12,236	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	0
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	0
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	0
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	0
第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	3.7
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	4.0
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	8.6
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	12.9
第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	5.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	17,310,062,925	3,145,035,108	14,165,027,817
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	3,975,335,196	5,420,865,904	12,719,497,109
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	3,287,324,947	5,855,394,358	10,151,427,698
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	1,307,931,638	2,732,701,316	8,726,658,020
第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	1,388,526,736	1,290,690,879	8,824,493,877

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	472,582,867,680	98.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,198,826,595	1.71
合計(純資産総額)		480,781,694,275	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	8,353,800,000	1.74

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,182,300	2,125.92	19,520,835,216	1,876.00	17,225,994,800	3.58
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,261,800	11,966.04	15,098,749,272	9,286.00	11,717,074,800	2.44
日本	株式	キーエンス	電気機器	182,500	51,489.69	9,396,868,425	47,900.00	8,741,750,000	1.82
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,215,400	3,983.08	8,824,115,432	3,906.00	8,653,352,400	1.80
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,628,200	738.13	8,583,123,266	651.50	7,575,772,300	1.58
日本	株式	任天堂	その他製品	1,137,000	5,833.87	6,633,119,286	5,854.00	6,655,998,000	1.38
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,441,000	4,540.20	6,542,428,200	4,243.00	6,114,163,000	1.27
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,583,100	3,746.95	5,931,796,545	3,767.00	5,963,537,700	1.24
日本	株式	日立製作所	電気機器	968,700	6,771.23	6,559,290,501	6,114.00	5,922,631,800	1.23
日本	株式	第一三共	医薬品	1,461,100	3,466.09	5,064,304,099	4,042.00	5,905,766,200	1.23
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,185,200	5,358.18	6,350,514,936	4,900.00	5,807,480,000	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,378,800	4,685.17	6,459,912,396	4,161.00	5,737,186,800	1.19
日本	株式	HOYA	精密機器	383,900	13,946.71	5,354,141,969	13,880.00	5,328,532,000	1.11
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,289,100	3,983.13	5,134,652,883	4,024.00	5,187,338,400	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,300,700	4,487.57	5,836,982,299	3,968.00	5,161,177,600	1.07
日本	株式	ダイキン工業	機械	220,000	20,685.24	4,550,752,800	22,295.00	4,904,900,000	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,472,600	3,188.42	4,695,267,292	3,137.00	4,619,546,200	0.96
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	127,800	59,098.28	7,552,760,184	35,700.00	4,562,460,000	0.95
日本	株式	信越化学工業	化学	312,700	18,201.23	5,691,524,621	14,330.00	4,480,991,000	0.93
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,993,800	1,492.57	4,468,456,066	1,446.50	4,330,531,700	0.90
日本	株式	三井物産	卸売業	1,394,200	3,183.13	4,437,919,846	3,089.00	4,306,683,800	0.90
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,658,400	2,459.25	4,078,420,200	2,565.00	4,253,796,000	0.88
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,189,300	3,722.07	4,426,657,851	3,501.00	4,163,739,300	0.87
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	204,700	19,686.77	4,029,881,819	19,705.00	4,033,613,500	0.84
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	665,200	5,410.46	3,599,037,992	5,806.00	3,862,151,200	0.80
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,381,900	1,531.63	3,648,189,497	1,562.50	3,721,718,750	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	549,500	8,231.94	4,523,451,030	6,632.00	3,644,284,000	0.76
日本	株式	日本電産	電気機器	447,500	8,644.00	3,868,190,000	8,130.00	3,638,175,000	0.76
日本	株式	ファナック	電気機器	176,800	21,341.82	3,773,233,776	20,260.00	3,581,968,000	0.75

日本	株式	S M C	機械	59,000	66,232.16	3,907,697,440	58,220.00	3,434,980,000	0.71
----	----	-------	----	--------	-----------	---------------	-----------	---------------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	2.23
		食料品	3.52
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.19
		化学	6.05
		医薬品	5.62
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.72
		鉄鋼	0.79
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.57
		機械	5.12
		電気機器	16.28
		輸送用機器	7.47
		精密機器	2.79
		その他製品	2.51
		電気・ガス業	1.23
		陸運業	3.30
		海運業	0.50
		空運業	0.48
		倉庫・運輸関連業	0.16
		情報・通信業	9.11
		卸売業	5.56
		小売業	4.62
		銀行業	5.25
		証券、商品先物取引業	0.73
		保険業	2.23
その他金融業	1.12		
不動産業	2.00		
サービス業	5.37		
		小計	98.29

合計	98.29
----	-------

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	455	円	8,435,699,650	8,353,800,000	1.74

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	524,623,346,850	84.12
地方債証券	日本	32,937,311,293	5.28
特殊債券	日本	36,905,161,716	5.92
社債券	日本	27,024,134,860	4.33
	フランス	894,911,000	0.14
	スペイン	398,132,000	0.06
	小計	28,317,177,860	4.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		864,544,827	0.14
合計(純資産総額)		623,647,542,546	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
--------	----	-----	----	------------	------------	-----------	-----------	--------	------	----------

日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,650,000,000	100.36	7,677,612,900	100.29	7,672,491,000	0.100	2024/9/20	1.23
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	7,600,000,000	100.06	7,604,560,000	99.93	7,595,136,000	0.005	2026/12/20	1.22
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	6,890,000,000	100.28	6,909,292,000	100.24	6,906,742,700	0.100	2023/12/20	1.11
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,890,000,000	100.33	6,913,241,000	99.97	6,888,070,800	0.100	2028/3/20	1.10
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,770,000,000	100.12	6,778,124,000	100.05	6,773,723,500	0.005	2026/6/20	1.09
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	6,740,000,000	98.86	6,663,191,600	98.69	6,651,908,200	0.100	2031/12/20	1.07
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,970,000,000	99.71	5,953,275,400	100.04	5,972,746,200	0.200	2032/3/20	0.96
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	100.51	5,930,503,000	100.37	5,922,184,000	0.100	2026/9/20	0.95
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	5,830,000,000	100.45	5,856,235,000	100.39	5,852,911,900	0.100	2025/6/20	0.94
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	100.48	5,777,600,000	100.28	5,766,617,500	0.100	2027/3/20	0.92
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,620,000,000	100.47	5,646,643,000	100.41	5,643,323,000	0.100	2025/9/20	0.90
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	5,590,000,000	100.30	5,607,105,400	100.26	5,604,701,700	0.100	2024/3/20	0.90
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	5,415,000,000	100.12	5,421,629,500	99.72	5,399,946,300	0.100	2028/12/20	0.87
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	5,340,000,000	101.21	5,404,614,000	101.07	5,397,511,800	0.300	2025/12/20	0.87
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	5,360,000,000	99.82	5,350,504,000	99.57	5,337,112,800	0.200	2032/6/20	0.86
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,210,000,000	99.01	5,158,819,000	98.42	5,127,942,500	0.100	2031/9/20	0.82
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,090,000,000	99.92	5,086,155,100	99.71	5,075,646,200	0.005	2027/6/20	0.81
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	5,000,000,000	100.41	5,020,800,000	100.05	5,002,550,000	0.100	2027/12/20	0.80
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	5,070,000,000	99.11	5,024,877,000	98.46	4,992,378,300	0.100	2031/6/20	0.80
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	4,940,000,000	100.27	4,953,387,400	99.88	4,934,368,400	0.100	2028/6/20	0.79
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	4,830,000,000	101.47	4,901,145,900	101.30	4,893,031,500	0.400	2025/9/20	0.78
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	4,890,000,000	99.46	4,863,936,300	98.75	4,828,923,900	0.100	2030/9/20	0.77
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	4,820,000,000	100.10	4,824,820,000	100.00	4,820,000,000	0.005	2026/9/20	0.77
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	100.49	4,783,514,400	100.43	4,780,563,200	0.100	2026/3/20	0.77
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	4,790,000,000	100.06	4,793,209,300	99.61	4,771,606,400	0.100	2029/3/20	0.77
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	4,750,000,000	100.43	4,770,465,500	100.36	4,767,527,500	0.100	2025/3/20	0.76
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	4,670,000,000	101.37	4,733,979,000	101.20	4,726,413,600	0.400	2025/6/20	0.76
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	4,660,000,000	100.33	4,675,797,400	100.26	4,672,349,000	0.100	2024/6/20	0.75
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	4,600,000,000	101.05	4,648,300,000	100.85	4,639,100,000	0.600	2023/12/20	0.74
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	101.27	4,618,231,200	101.10	4,610,524,800	0.400	2025/3/20	0.74

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	84.12
地方債証券	5.28
特殊債券	5.92
社債券	4.54
合計	99.86

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	360,405,568,493	68.07
	イギリス	21,478,655,320	4.06
	カナダ	19,548,508,275	3.69
	スイス	17,037,297,746	3.22
	フランス	14,877,099,092	2.81
	オーストラリア	10,892,408,576	2.06
	ドイツ	10,750,237,138	2.03
	アイルランド	8,986,242,405	1.70
	オランダ	8,568,496,108	1.62
	スウェーデン	4,478,418,649	0.85
	デンマーク	3,820,300,890	0.72
	スペイン	3,442,000,415	0.65
	香港	3,107,128,130	0.59
	イタリア	2,409,794,522	0.46
	シンガポール	1,815,442,348	0.34
	フィンランド	1,773,824,271	0.34
	ジャージー	1,614,367,527	0.30
	イスラエル	1,227,882,808	0.23

	ノルウェー	1,137,714,859	0.21
	ベルギー	1,130,167,136	0.21
	ケイマン	1,026,131,544	0.19
	バミューダ	724,533,317	0.14
	キュラソー	586,127,195	0.11
	ニュージーランド	367,396,237	0.07
	ルクセンブルク	321,733,929	0.06
	ポルトガル	266,518,332	0.05
	オーストリア	264,009,681	0.05
	パナマ	111,901,458	0.02
	リベリア	105,959,197	0.02
	マン島	88,047,015	0.02
	小計	502,363,912,613	94.89
投資信託受益証券	オーストラリア	157,210,629	0.03
	香港	76,842,958	0.01
	アメリカ	16,079,847	0.00
	小計	250,133,434	0.05
投資証券	アメリカ	10,259,276,042	1.94
	オーストラリア	597,653,735	0.11
	シンガポール	245,753,238	0.05
	イギリス	189,585,132	0.04
	香港	170,655,581	0.03
	フランス	170,346,736	0.03
	カナダ	50,736,115	0.01
	ベルギー	43,632,232	0.01
	小計	11,727,638,811	2.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,099,833,082	2.85
合計(純資産総額)		529,441,517,940	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,086,152,195	2.09
	買建	カナダ	780,467,556	0.15
	買建	ドイツ	2,504,564,632	0.47
	買建	イギリス	278,037,110	0.05
	買建	オーストラリア	493,224,792	0.09

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		272,779,595	0.05
	売建		3,418,025,681	0.65

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,323,830	21,718.77	28,751,971,325	20,632.52	27,313,960,601	5.16
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	581,193	39,589.15	23,008,941,821	34,392.37	19,988,607,603	3.78
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	749,309	16,771.10	12,566,737,132	16,624.18	12,456,653,686	2.35
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	216,377	36,793.79	7,961,330,054	38,839.49	8,403,972,349	1.59
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	492,726	16,280.30	8,021,729,911	14,107.39	6,951,077,944	1.31
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	460,933	16,355.57	7,538,824,664	14,204.41	6,547,282,651	1.24
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	76,869	73,492.27	5,649,277,714	73,683.67	5,663,990,206	1.07
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	215,641	26,151.33	5,639,299,026	23,825.58	5,137,773,902	0.97
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	343,717	14,114.98	4,851,559,705	12,841.75	4,413,928,060	0.83
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	105,127	46,133.67	4,849,895,208	39,037.87	4,103,935,190	0.78
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	187,450	28,206.93	5,287,389,707	19,753.53	3,702,799,592	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	240,076	18,977.60	4,556,067,885	15,373.02	3,690,695,454	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	196,677	21,509.38	4,230,401,447	18,637.04	3,665,478,493	0.69
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	230,976	17,316.26	3,999,641,038	15,832.68	3,656,970,204	0.69

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	205,210	27,153.53	5,572,177,396	17,695.78	3,631,351,424	0.69
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	134,653	30,821.62	4,150,224,376	26,074.48	3,511,008,113	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	84,000	44,659.40	3,751,389,936	40,304.96	3,385,617,253	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	153,061	25,747.21	3,940,894,934	20,964.14	3,208,792,799	0.61
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	66,242	46,730.34	3,095,511,196	47,788.74	3,165,622,252	0.60
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	144,953	21,671.16	3,141,300,077	20,667.28	2,995,784,702	0.57
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	70,879	51,790.01	3,670,824,489	41,527.16	2,943,403,836	0.56
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	460,155	7,778.39	3,579,268,839	6,394.80	2,942,603,611	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	337,769	9,353.61	3,159,361,216	8,191.90	2,766,970,445	0.52
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	113,421	24,871.80	2,820,985,530	24,126.79	2,736,485,114	0.52
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	57,316	48,924.21	2,804,140,565	47,582.74	2,727,252,612	0.52
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	591,261	5,356.80	3,167,271,725	4,439.87	2,625,124,696	0.50
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	207,468	13,452.79	2,791,025,303	12,546.33	2,602,963,735	0.49
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	36,343	68,399.25	2,485,834,051	69,361.09	2,520,790,232	0.48
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	32,118	82,891.38	2,662,305,555	74,810.29	2,402,757,026	0.45
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	124,048	18,609.60	2,308,484,549	19,151.12	2,375,658,444	0.45

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.29
		素材	4.00
		資本財	5.80
		商業・専門サービス	1.20
		運輸	1.86

	自動車・自動車部品	2.36
	耐久消費財・アパレル	1.52
	消費者サービス	1.79
	メディア・娯楽	5.32
	小売	4.90
	食品・生活必需品小売り	1.56
	食品・飲料・タバコ	4.32
	家庭用品・パーソナル用品	1.76
	ヘルスケア機器・サービス	4.84
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.01
	銀行	5.66
	各種金融	4.50
	保険	3.11
	不動産	0.38
	ソフトウェア・サービス	10.61
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.55
	電気通信サービス	1.43
	公益事業	3.17
	半導体・半導体製造装置	3.96
	小計	94.89
投資信託受益証券		0.05
投資証券		2.22
合計		97.15

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	419	アメリカドル	84,470,468	12,232,168,471	76,556,537.5	11,086,152,195	2.09
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	33	カナダドル	7,810,314.5	826,331,274	7,376,820	780,467,556	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	66	スイスフラン	7,070,022	1,050,463,868	6,683,160	992,983,912	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	325	ユーロ	11,435,672.5	1,627,524,910	10,621,000	1,511,580,720	0.29
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	5,586,849	526,113,570	5,237,600	493,224,792	0.09

イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	25	イギリス ポンド	1,819,133.75	294,190,310	1,719,250	278,037,110	0.05
------	--------------------	----------	----	----	-------------	--------------	-------------	-----------	-------------	------

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,175,000.00	170,081,250	170,088,065	0.03
	カナダドル	買建	500,000.00	52,658,000	52,884,500	0.01
	ユーロ	買建	350,000.00	49,806,400	49,807,030	0.01
	アメリカドル	売建	18,100,000.00	2,611,649,000	2,620,326,140	0.49
	カナダドル	売建	1,400,000.00	148,022,000	148,076,600	0.03
	ユーロ	売建	2,650,000.00	370,629,000	377,119,910	0.07
	イギリスポンド	売建	1,180,000.00	184,137,820	190,786,176	0.04
	スイスフラン	売建	550,000.00	81,169,550	81,716,855	0.02

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	164,863,387,073	51.59
	フランス	26,501,003,754	8.29
	イタリア	23,052,731,332	7.21
	ドイツ	19,683,294,030	6.16
	スペイン	15,516,179,389	4.86
	イギリス	13,006,360,433	4.07
	中国	9,162,239,902	2.87
	カナダ	6,488,698,055	2.03
	ベルギー	5,845,418,093	1.83
	オランダ	4,841,911,633	1.52
	オーストラリア	4,770,830,228	1.49
	オーストリア	3,699,374,508	1.16
	メキシコ	2,567,078,401	0.80
	アイルランド	1,983,060,436	0.62
フィンランド	1,641,007,139	0.51	

	マレーシア	1,610,583,573	0.50
	シンガポール	1,367,575,158	0.43
	ポーランド	1,318,447,884	0.41
	イスラエル	1,168,126,473	0.37
	デンマーク	1,116,435,313	0.35
	スウェーデン	789,226,059	0.25
	ノルウェー	632,305,784	0.20
	小計	311,625,274,650	97.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,958,449,411	2.49
合計(純資産総額)		319,583,724,061	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	2,603,562,806	0.81
	買建	ドイツ	2,089,645,422	0.65

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		5,134,055,230	1.61

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	21,030,000	12,736.67	2,678,522,531	11,802.01	2,481,963,755	1.375	2031/11/15	0.78
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	19,380,000	12,698.25	2,460,922,417	11,739.79	2,275,171,693	1.250	2031/8/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	13,195.24	1,913,310,615	12,361.45	1,792,411,224	1.250	2028/9/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	14,344.10	1,913,504,189	13,381.34	1,785,071,965	2.625	2029/2/15	0.56

アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	13,943.61	1,812,670,498	13,660.78	1,775,902,334	0.250	2024/3/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	12,693.50	1,910,371,984	11,762.41	1,770,243,997	1.125	2031/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	17,350,000	11,597.31	2,012,134,606	10,019.04	1,738,303,765	2.000	2051/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/23	12,000,000	14,116.14	1,693,937,606	13,920.14	1,670,417,288	0.250	2023/9/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,183.84	1,658,091,198	13,458.27	1,573,272,859	2.375	2027/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	11,530,000	13,851.99	1,597,134,976	13,349.10	1,539,151,949	2.250	2027/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.25% 11/15/23	11,000,000	14,069.76	1,547,673,841	13,851.98	1,523,717,972	0.250	2023/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	13,332.13	1,577,191,718	12,726.31	1,505,522,490	0.750	2026/8/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.5% 04/30/27	11,940,000	12,758.99	1,523,424,189	12,351.27	1,474,742,215	0.500	2027/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	13,851.98	1,504,325,198	13,466.19	1,462,429,183	0.750	2024/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/31/25	10,900,000	13,258.51	1,445,178,024	13,037.99	1,421,141,012	0.250	2025/5/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	13,446.40	1,479,104,051	12,880.73	1,416,881,004	0.750	2026/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	14,363.90	1,457,936,610	13,905.71	1,411,430,547	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	13,976.71	1,397,671,047	13,734.60	1,373,460,625	0.125	2024/1/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	12,000,000	12,311.74	1,477,409,544	11,442.25	1,373,070,319	0.625	2030/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	14,023.94	1,433,247,019	13,330.43	1,362,370,903	2.000	2026/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	13,209.38	1,472,846,670	12,194.58	1,359,696,330	1.625	2031/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	12,245.49	1,463,336,727	11,377.76	1,359,643,159	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	13,877.15	1,387,715,360	13,574.52	1,357,452,329	0.250	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	12,468.36	1,390,222,958	11,570.09	1,290,065,347	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	13,108.13	1,338,340,407	12,293.57	1,255,174,214	1.125	2028/8/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.75% 08/15/41	12,330,000	11,479.08	1,415,371,636	9,995.28	1,232,418,523	1.750	2041/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	13,851.41	1,248,012,575	13,528.70	1,218,936,278	0.375	2024/7/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	13,842.93	1,245,863,784	13,532.38	1,217,914,326	0.250	2024/6/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	12,875.64	1,287,564,547	12,177.61	1,217,761,594	0.625	2027/12/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	14,074.08	1,238,519,383	13,673.23	1,203,244,391	1.500	2024/11/30	0.38

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	97.51
合計	97.51

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	65	アメリカドル	7,136,783.64	1,033,477,639	7,005,273.6	1,014,433,670	0.32

アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	49	アメリカドル	5,659,449.76	819,544,920	5,510,203.37	797,932,550	0.25
アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	43	アメリカドル	5,732,151.65	830,072,879	5,463,687.5	791,196,586	0.25
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	25	ユーロ	2,694,067.5	383,419,687	2,674,625	380,652,630	0.12
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	35	ユーロ	4,258,663.5	606,092,989	4,170,600	593,559,792	0.19
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	57	ユーロ	8,170,229.7	1,162,787,091	7,837,500	1,115,433,000	0.35

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	19,490,000.00	2,785,702,696	2,818,649,647	0.88
	カナダドル	買建	1,950,000.00	211,151,265	206,028,225	0.06
	ユーロ	買建	11,760,000.00	1,678,758,872	1,673,098,728	0.52
	イギリスポンド	買建	1,650,000.00	271,501,660	266,554,860	0.08
	オフショア人民元	買建	8,350,000.00	170,609,177	169,723,770	0.05

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン	17,913,727,795	16.64
	インド	15,532,842,900	14.43
	台湾	14,000,867,732	13.01
	中国	12,565,639,754	11.67
	韓国	10,963,046,831	10.18
	ブラジル	5,574,936,584	5.18
	サウジアラビア	4,905,065,092	4.56
	南アフリカ	3,364,650,233	3.13
	インドネシア	2,273,499,813	2.11

	メキシコ	2,201,413,327	2.04
	タイ	2,137,954,709	1.99
	マレーシア	1,521,444,466	1.41
	アラブ首長国連邦	1,446,882,625	1.34
	カタール	1,287,279,976	1.20
	香港	1,190,610,607	1.11
	クウェート	891,145,812	0.83
	フィリピン	765,884,297	0.71
	チリ	562,746,851	0.52
	バミューダ	553,046,018	0.51
	ポーランド	506,756,941	0.47
	アメリカ	424,843,716	0.39
	トルコ	382,369,347	0.36
	ギリシャ	255,565,400	0.24
	チェコ	196,513,317	0.18
	ハンガリー	175,060,655	0.16
	コロンビア	144,579,976	0.13
	ルクセンブルク	98,519,983	0.09
	エジプト	45,359,068	0.04
	シンガポール	25,073,181	0.02
	ペルー	16,524,008	0.02
	ロシア	191	0.00
	小計	101,923,851,205	94.68
投資信託受益証券	ブラジル	195,508,404	0.18
	メキシコ	49,028,950	0.05
	小計	244,537,354	0.23
投資証券	メキシコ	58,613,010	0.05
	南アフリカ	44,798,206	0.04
	小計	103,411,216	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,384,445,708	5.00
合計(純資産総額)		107,656,245,483	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,398,409,640	5.01

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		107,125,276	0.10

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	3,027,389	2,752.87	8,334,031,744	1,978.51	5,989,720,924	5.56
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	767,900	8,037.98	6,172,368,326	4,992.57	3,833,794,503	3.56
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	586,345	7,094.16	4,159,628,422	5,323.11	3,121,184,796	2.90
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	1,868,988	2,775.38	5,187,165,221	1,417.88	2,650,005,378	2.46
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	541,400	4,700.47	2,544,836,537	3,140.19	1,700,098,866	1.58
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	375,247	4,524.72	1,697,890,338	4,162.28	1,561,885,710	1.45
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	411,657	3,088.87	1,271,557,982	2,503.58	1,030,617,673	0.96
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	264,511	5,253.70	1,389,663,568	3,726.90	985,806,046	0.92
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	637,362	1,401.78	893,442,143	1,510.58	962,786,927	0.89
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	11,581,620	96.94	1,122,801,469	81.36	942,332,720	0.88
ブラジル	株式	VALE SA	素材	493,487	1,821.03	898,659,473	1,833.49	904,804,906	0.84
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	各種金融	214,032	5,122.08	1,096,290,383	4,005.12	857,224,914	0.80

サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	237,965	3,556.43	846,307,644	3,138.18	746,777,004	0.69
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,510,248	490.11	740,190,201	461.65	697,209,689	0.65
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	276,263	2,586.72	714,615,227	2,435.65	672,882,738	0.63
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	111,824	6,254.85	699,442,611	5,365.16	599,954,435	0.56
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	267,900	2,695.07	722,010,285	2,129.13	570,393,927	0.53
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	258,430	2,890.95	747,108,471	2,169.72	560,720,740	0.52
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	784,500	1,035.30	812,200,635	707.55	555,078,859	0.52
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	62,365	11,361.53	708,562,017	8,800.10	548,818,467	0.51
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	6,769,300	73.11	494,932,338	79.56	538,582,431	0.50
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	65,667	11,081.48	727,688,072	8,176.95	536,956,432	0.50
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	104,076	4,332.36	450,895,164	4,833.98	503,101,771	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	103,443	6,601.32	682,861,307	4,796.88	496,203,658	0.46
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	27,673	19,708.44	545,391,825	17,713.46	490,184,634	0.46
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	188,804	4,321.81	815,976,679	2,469.72	466,294,318	0.43
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	9,806,200	51.50	505,048,259	46.86	459,547,951	0.43
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	576,440	723.63	417,130,356	785.32	452,691,790	0.42
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,699,515	78.57	526,439,580	66.05	442,509,665	0.41
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	563,501	830.09	467,761,558	784.65	442,155,004	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.96
		素材	8.12
		資本財	3.51
		商業・専門サービス	0.08
		運輸	2.03
		自動車・自動車部品	3.40
		耐久消費財・アパレル	1.64
		消費者サービス	1.17
		メディア・娯楽	6.11

小売	7.21
食品・生活必需品小売り	1.31
食品・飲料・タバコ	3.97
家庭用品・パーソナル用品	0.93
ヘルスケア機器・サービス	1.02
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.70
銀行	15.60
各種金融	3.12
保険	2.32
不動産	1.84
ソフトウェア・サービス	2.48
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.03
電気通信サービス	3.15
公益事業	3.07
半導体・半導体製造装置	7.91
小計	94.68
投資信託受益証券	0.23
投資証券	0.10
合計	95.00

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	852	アメリカドル	40,434,448	5,855,312,414	37,279,260	5,398,409,640	5.01

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	740,000.00	106,912,600	107,125,276	0.10

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	ブラジル	8,892,561,106	10.23
	中国	8,801,768,967	10.12
	メキシコ	8,724,656,155	10.04
	インドネシア	8,665,294,251	9.97
	マレーシア	8,592,052,014	9.88
	タイ	8,516,524,242	9.80
	南アフリカ	8,350,417,944	9.61
	ポーランド	5,767,226,733	6.63
	チェコ	4,327,884,150	4.98
	コロンビア	3,513,282,913	4.04
	ルーマニア	3,005,168,896	3.46
	ハンガリー	2,325,881,621	2.68
	ペルー	2,042,766,546	2.35
	チリ	1,648,995,051	1.90
	ウルグアイ	124,584,857	0.14
	ドミニカ共和国	86,497,660	0.10
	フィリピン	66,180,690	0.08
	小計	83,451,743,796	96.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,481,121,040	4.00
合計(純資産総額)		86,932,864,836	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	118,100,000	2,149.38	2,538,422,362	2,305.30	2,722,570,936	0.000	2024/1/1	3.13
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	3.65	2,389,023,559	2.83	1,851,696,299	9.850	2027/6/28	2.13
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	182,400,000	886.55	1,617,075,060	833.39	1,520,114,195	10.500	2026/12/21	1.75
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	53,300,000	2,218.01	1,182,201,647	2,438.43	1,299,686,794	0.000	2023/7/1	1.50
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	182,600,000	736.80	1,345,413,571	691.08	1,261,927,747	8.000	2030/1/31	1.45

メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	198,300,000	680.56	1,349,559,255	631.52	1,252,313,856	5.750	2026/3/5	1.44
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000	2,530.55	1,042,589,547	2,520.62	1,038,499,544	10.000	2027/1/1	1.19
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	158,100,000	724.84	1,145,978,806	637.56	1,007,997,103	7.750	2031/5/29	1.16
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	158,200,000	674.30	1,066,752,242	604.66	956,574,018	8.750	2048/2/28	1.10
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	736.18	945,256,594	689.17	884,898,672	8.000	2024/9/5	1.02
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	129,000,000	716.42	924,194,533	660.46	851,994,148	8.250	2032/3/31	0.98
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000	2,561.31	814,498,759	2,587.36	822,781,057	10.000	2025/1/1	0.95
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	37,100,000,000	2.93	1,087,254,252	2.13	792,403,224	7.250	2034/10/18	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	115,100,000	772.04	888,628,426	676.99	779,216,775	8.500	2029/5/31	0.90
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	38,900,000	1,880.84	731,648,217	1,979.39	769,984,356	0.000	2025/7/1	0.89
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000	729.78	831,958,648	658.73	750,958,617	7.500	2027/6/3	0.86
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	104,250,000	776.58	809,589,412	714.50	744,874,904	10.000	2024/12/5	0.86
タイ	国債証券	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000	425.90	766,631,513	400.97	721,749,636	3.775	2032/6/25	0.83
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	110,000,000	719.68	791,655,202	656.02	721,630,338	8.875	2035/2/28	0.83
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	23,000,000	3,236.71	744,444,325	3,130.17	719,940,627	3.955	2025/9/15	0.83
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	116,000,000	667.90	774,770,525	609.03	706,483,825	8.750	2044/1/31	0.81
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	113,700,000	686.44	780,486,248	619.66	704,554,398	8.500	2037/1/31	0.81
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000	440.20	772,562,629	396.32	695,541,618	3.650	2031/6/20	0.80
タイ	国債証券	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000	387.75	713,471,998	376.94	693,573,924	1.450	2024/12/17	0.80
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	30,850,000	2,018.78	622,795,882	2,194.60	677,036,215	0.000	2024/7/1	0.78
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	25,350,000	2,835.08	718,693,037	2,631.79	667,161,218	3.250	2025/7/25	0.77
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	26,700,000	2,435.61	650,308,702	2,452.03	654,693,669	10.000	2029/1/1	0.75
マレーシア	国債証券	MGS 3.899% 11/16/27	20,800,000	3,206.60	666,974,818	3,098.96	644,583,958	3.899	2027/11/16	0.74
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000	771.11	758,006,172	648.04	637,024,377	8.500	2038/11/18	0.73
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	100,300,000	694.49	696,578,363	631.96	633,864,386	9.000	2040/1/31	0.73

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.00
合計	96.00

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

J - R E I T インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	114,127,594,400	96.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,031,452,995	3.41
合計(純資産総額)		118,159,047,395	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	4,005,716,000	3.39

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	12,309	704,125.24	8,667,077,579	636,000	7,828,524,000	6.63
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,551	672,009.38	7,090,370,968	597,000	6,298,947,000	5.33
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	53,236	101,332.07	5,394,514,078	108,800	5,792,076,800	4.90
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	17,289	367,837.66	6,359,545,303	316,500	5,471,968,500	4.63
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	34,120	165,635.64	5,651,488,036	159,700	5,448,964,000	4.61
日本	投資証券	G L P 投資法人	32,493	182,687.16	5,936,053,889	160,100	5,202,129,300	4.40
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,904	324,320.2	5,157,988,460	301,000	4,787,104,000	4.05
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	21,023	180,661.31	3,798,042,720	185,000	3,889,255,000	3.29
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,550	358,690.79	3,784,187,834	354,500	3,739,975,000	3.17

日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	23,752	141,948.44	3,371,559,346	149,500	3,550,924,000	3.01
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,216	409,566.85	2,955,434,389	393,000	2,835,888,000	2.40
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	32,064	84,348.52	2,704,550,945	81,200	2,603,596,800	2.20
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	15,767	202,443.73	3,191,930,290	164,100	2,587,364,700	2.19
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,025	66,059.86	2,247,686,736	72,100	2,453,202,500	2.08
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,643	635,454.72	2,314,961,544	656,000	2,389,808,000	2.02
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,570	447,069.12	2,490,174,998	423,000	2,356,110,000	1.99
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,114	327,874.61	2,332,499,975	310,500	2,208,897,000	1.87
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	46,440	42,848.3	1,989,875,052	45,600	2,117,664,000	1.79
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,101	705,771.88	2,188,598,599	681,000	2,111,781,000	1.79
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,916	188,145.57	2,430,088,182	161,900	2,091,100,400	1.77
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,915	510,319.03	1,997,899,002	533,000	2,086,695,000	1.77
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,168	580,655.34	2,420,171,457	495,000	2,063,160,000	1.75
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,407	154,230.8	1,913,541,535	156,300	1,939,214,100	1.64
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,679	153,867.8	1,797,022,036	156,000	1,821,924,000	1.54
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	14,275	113,247.12	1,616,602,638	114,800	1,638,770,000	1.39
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,872	169,645.5	1,674,740,376	165,500	1,633,816,000	1.38
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,567	213,893.79	1,618,534,308	214,200	1,620,851,400	1.37
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,908	323,841.75	1,589,415,309	329,000	1,614,732,000	1.37
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	10,142	151,844.38	1,540,005,701	147,700	1,497,973,400	1.27
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,205	726,623.08	1,602,203,891	672,000	1,481,760,000	1.25

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.59
合計	96.59

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,068	円	4,131,657,200	4,005,716,000	3.39

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	74,598,025,121	77.65
	オーストラリア	6,001,365,281	6.25
	イギリス	4,006,517,972	4.17
	シンガポール	3,693,986,747	3.85
	カナダ	1,735,319,163	1.81
	フランス	1,386,421,477	1.44
	香港	1,346,737,255	1.40
	ベルギー	959,188,863	1.00
	ニュージーランド	373,635,395	0.39
	スペイン	340,358,287	0.35
	韓国	227,429,409	0.24
	ガーンジー	199,789,474	0.21
	オランダ	166,374,200	0.17
	イスラエル	141,475,056	0.15
	ドイツ	42,880,446	0.04
	アイルランド	33,593,213	0.03
	イタリア	12,840,011	0.01
	小計	95,265,937,370	99.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		805,251,338	0.84
合計(純資産総額)		96,071,188,708	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		153,728,002	0.16

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	421,275	21,137.17	8,904,562,418	14,653.32	6,173,079,026	6.43
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	51,844	112,488.60	5,831,859,214	81,294.88	4,214,652,065	4.39
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	89,962	47,342.89	4,259,061,323	41,631.42	3,745,246,427	3.90
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	351,831	9,923.92	3,491,544,572	8,391.73	2,952,474,100	3.07
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	264,125	12,260.67	3,238,351,193	9,170.81	2,422,242,119	2.52
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	186,604	22,908.09	4,274,741,771	12,906.91	2,408,482,023	2.51
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	548,984	4,273.69	2,346,192,319	4,255.96	2,336,457,184	2.43
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	163,323	22,131.55	3,614,592,230	14,033.53	2,291,999,380	2.39
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	79,244	34,151.66	2,706,314,837	26,283.01	2,082,771,241	2.17
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	75,921	28,366.37	2,153,603,546	24,448.27	1,856,137,281	1.93
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	191,925	12,209.95	2,343,394,914	9,589.31	1,840,429,895	1.92
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	84,218	28,914.24	2,435,100,038	20,047.49	1,688,360,052	1.76
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	328,934	5,799.34	1,907,601,996	4,906.16	1,613,803,754	1.68
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	218,421	8,197.06	1,790,411,925	6,946.53	1,517,269,274	1.58
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	970,492	2,163.81	2,099,963,799	1,528.37	1,483,279,690	1.54
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	65,934	28,988.85	1,911,351,123	22,245.71	1,466,748,788	1.53
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	70,001	27,211.51	1,904,833,156	19,417.57	1,359,249,521	1.41
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	226,148	7,655.23	1,731,216,700	5,741.71	1,298,477,703	1.35
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	36,986	48,256.42	1,784,812,139	34,560.35	1,278,249,275	1.33
香港	投資証券	LINK REIT	1,194,400	1,269.20	1,515,933,293	1,000.91	1,195,489,890	1.24
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	118,233	11,279.38	1,333,595,552	9,958.58	1,177,433,227	1.23
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	165,060	6,904.33	1,139,629,307	6,344.12	1,047,161,454	1.09
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	60,498	23,143.29	1,400,123,232	17,119.43	1,035,691,772	1.08
アメリカ	投資証券	UDR INC	173,714	7,836.66	1,361,338,728	5,948.79	1,033,388,940	1.08
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	306,402	4,802.02	1,471,349,551	3,269.80	1,001,876,262	1.04
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	409,446	2,631.51	1,077,463,562	2,286.54	936,218,710	0.97
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	353,118	3,338.83	1,179,004,323	2,618.16	924,521,118	0.96
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	145,860	6,995.97	1,020,433,565	6,309.37	920,284,956	0.96
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	98,864	12,046.23	1,190,938,739	9,020.21	891,774,526	0.93
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	81,461	16,538.74	1,347,263,068	10,814.41	880,952,718	0.92

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.16
合計	99.16

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	630,000.00	91,192,500	91,196,154	0.09
	ユーロ	買建	80,000.00	11,188,800	11,384,752	0.01
	イギリスポンド	買建	65,000.00	10,507,705	10,508,615	0.01
	オーストラリアドル	買建	290,000.00	27,215,764	27,300,687	0.03
	シンガポールドル	買建	132,000.00	13,263,492	13,337,794	0.01

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

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

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	32,884,734,109	103.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,185,701,347	3.74
合計(純資産総額)		31,699,032,762	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		32,613,930,872	102.89

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信託受益 証券	ISHARES GOLD TRUST	7,204,595	4,791.21	34,518,782,281	4,564.41	32,884,734,109	103.74

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	103.74
合計	103.74

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの


種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	225,345,290.00	31,367,599,943	32,613,930,872	102.89

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

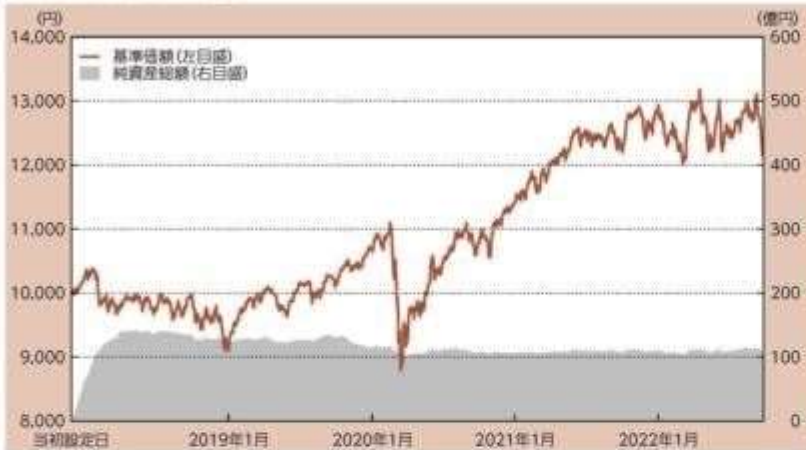
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

 当初設定日：2017年11月30日
 作成基準日：2022年9月30日

基準価額・純資産の推移

基準価額 12,236円

純資産総額 107.44億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年8月	0円
2019年8月	0円
2020年8月	0円
2021年8月	0円
2022年8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	筆種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券インデックスマザーファンド	24.9%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.2%
		T 1.25% 08/15/31	アメリカ	国債	-	1.250%	2031/08/15	0.2%
外国株式インデックスマザーファンド	24.6%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア	-	-	1.3%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.9%
新興国債券インデックスマザーファンド	12.5%	BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.4%
		COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.3%
新興国株式インデックスマザーファンド	11.2%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.6%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.4%
ゴールドマザーファンド (為替ヘッジあり)	9.2%	ISHARES GOLD TRUST	アメリカ	投資信託 商品先物	-	-	-	9.5%
グローバルIMBITインデックスマザーファンド	5.1%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.3%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.2%
J-REITインデックスマザーファンド	4.9%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.3%
		ジェパシリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.3%
国内株式インデックスマザーファンド	3.8%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	3.0%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.0%
		第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/12/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)


※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】
1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2017年11月30日（設定日）から2027年 8月20日までとします。

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

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年11月30日から2018年8月20日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が30億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受

託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2021年8月21日から2022年8月22日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【グローバル経済コア】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2021年 8月20日現在)	第5期 (2022年 8月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	125,888,410	122,836,855
親投資信託受益証券	10,651,006,807	11,295,326,745
未収入金	-	54,817,215
流動資産合計	10,776,895,217	11,472,980,815
資産合計	10,776,895,217	11,472,980,815
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,650,237	14,600,352
未払受託者報酬	2,949,977	3,004,538
未払委託者報酬	47,199,550	48,072,518
未払利息	225	51
その他未払費用	294,936	300,393
流動負債合計	60,094,925	65,977,852
負債合計	60,094,925	65,977,852
純資産の部		
元本等		
元本	8,726,658,020	8,824,493,877
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	1,990,142,272	2,582,509,086
(分配準備積立金)	1,692,183,910	1,988,626,089
元本等合計	10,716,800,292	11,407,002,963
純資産合計	10,716,800,292	11,407,002,963
負債純資産合計	10,776,895,217	11,472,980,815

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2020年 8月21日	自	2021年 8月21日
	至	2021年 8月20日	至	2022年 8月22日
営業収益				
受取利息		489		753
有価証券売買等損益		1,395,777,839		673,112,340
営業収益合計		1,395,778,328		673,113,093
営業費用				
支払利息		49,099		38,751
受託者報酬		5,913,508		6,020,882
委託者報酬		94,615,898		96,333,986
その他費用		591,226		601,964
営業費用合計		101,169,731		102,995,583
営業利益又は営業損失（ ）		1,294,608,597		570,117,510
経常利益又は経常損失（ ）		1,294,608,597		570,117,510
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,294,608,597		570,117,510
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（ ）		185,155,316		40,087,637
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		893,559,744		1,990,142,272
剰余金増加額又は欠損金減少額		233,771,801		357,579,898
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		233,771,801		357,579,898
剰余金減少額又は欠損金増加額		246,642,554		295,242,957
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		246,642,554		295,242,957
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,990,142,272		2,582,509,086

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は2021年 8月21日から2022年 8月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 (2021年 8月20日現在)	第5期 (2022年 8月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,726,658,020口	8,824,493,877口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2281円 (12,281円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2927円 (12,927円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2020年 8月21日 至 2021年 8月20日			第5期 自 2021年 8月21日 至 2022年 8月22日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	183,770,898円	費用控除後の配当等収益額	A	206,261,243円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	925,682,383円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	323,768,630円
収益調整金額	C	297,958,362円	収益調整金額	C	593,882,997円
分配準備積立金額	D	582,730,629円	分配準備積立金額	D	1,458,596,216円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,990,142,272円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,582,509,086円
当ファンドの期末残存口数	F	8,726,658,020口	当ファンドの期末残存口数	F	8,824,493,877口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,280円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,926円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金額	I=F×H/10,000	- 円	収益分配金額	I=F×H/10,000	- 円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第5期 自 2021年 8月21日 至 2022年 8月22日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第5期 (2022年 8月22日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第4期	第5期
	自 2020年 8月21日 至 2021年 8月20日	自 2021年 8月21日 至 2022年 8月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	10,151,427,698円	8,726,658,020円
期中追加設定元本額	1,307,931,638円	1,388,526,736円
期中一部解約元本額	2,732,701,316円	1,290,690,879円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期	第5期
	(2021年 8月20日現在)	(2022年 8月22日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,195,580,920	641,866,199
合計	1,195,580,920	641,866,199

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	246,941,770	547,618,069
	グローバルREITインデックス マザーファンド	238,649,777	647,242,060
	新興国株式インデックス マザーファンド	360,466,469	1,307,159,556
	国内株式インデックス マザーファンド	222,707,945	438,846,005
	外国株式インデックス マザーファンド	643,351,922	2,911,424,787
	国内債券インデックス マザーファンド	234,660,673	323,479,737
	外国債券インデックス マザーファンド	860,118,900	2,720,126,021
	新興国債券インデックス マザーファンド	751,274,431	1,349,589,387
	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	877,133,531	1,049,841,123
合計		4,435,305,418	11,295,326,745

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 8月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,761,040,789
株式	517,126,614,130
派生商品評価勘定	56,726,850
未収入金	5,478,750
未収配当金	708,323,589
差入委託証拠金	81,672,400
流動資産合計	519,739,856,508
資産合計	519,739,856,508
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	798,000
前受金	55,951,400
未払解約金	249,581,491
未払利息	740

	2022年 8月22日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	306,331,631
負債合計	306,331,631
純資産の部	
元本等	
元本	263,601,210,392
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	255,832,314,485
元本等合計	519,433,524,877
純資産合計	519,433,524,877
負債純資産合計	519,739,856,508

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 8月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 8月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	263,601,210,392口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.9705円 (1万口当たり純資産額) (19,705円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 8月22日現在
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月22日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2022年 8月22日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	252,388,145,127円
期中追加設定元本額	34,347,104,112円
期中一部解約元本額	23,134,038,847円
期末元本額	263,601,210,392円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	394,864,377円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,021,101,338円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,527,957円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,674,259,359円
世界経済インデックスファンド	4,078,743,395円
日本株式インデックス・オープン	3,269,055,257円
DCマイセレクション25	6,239,690,650円
DCマイセレクション50	19,078,107,441円
DCマイセレクション75	19,050,443,617円
DC日本株式インデックス・オープン	6,183,217,893円
DCマイセレクションS25	3,192,692,659円
DCマイセレクションS50	9,376,667,173円

区分	2022年 8月22日現在
D CマイセレクションS 7 5	7,196,287,710円
D C日本株式インデックス・オープンS	8,399,294,003円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 2 5	196,052,399円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 3 5	713,098,817円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 4 5	521,949,217円
D C世界経済インデックスファンド	3,699,343,534円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,646,369,673円
国内バランス6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,324,278円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	19,221,125円
マイセレクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	21,109,086円
日本株式インデックス・オープンV A 1（適格機関投資家専用）	173,651,528円
国内バランス6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	28,692,199円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	109,223,677円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	25,432,978円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	70,429,312円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	864,453,724円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	428,841,621円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,772,185,960円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	45,623,436円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	17,757,243円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	470,963,700円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	267,604,093円
バランスF（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	342,411,253円
国内バランス2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	35,108,426円
F O F s用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	585,399,788円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,322,989,958円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,898,331,470円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,988,835,060円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンドA	1,440,100,504円
分散投資コア戦略ファンドS	6,097,040,794円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	497,351,765円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	434,842,214円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,880,527,274円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	221,992,862円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,938,826円
S M T インデックスバランス・オープン	58,270,103円
国内株式S M T Bセレクション（SMA専用）	31,352,559,282円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	550,582,732円
S M T 世界経済インデックス・オープン	49,693,398円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	188,210,721円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	33,660,116円

区分	2022年 8月22日現在
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,086,298円
グローバル経済コア	222,707,945円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	28,836,171円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	134,351,309円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	24,645,195円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,309,165,117円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	223,507,528円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	19,229,111円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	15,591,667円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	5,962,966円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	8,206,104円
10資産分散投資ファンド	32,436円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,585,041,528円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	894,140,442円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	317,109,017円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	53,182,306円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	226,775,993円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	45,737,030,999円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,684,912円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	196,143,433円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 8月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		18,326,042,554
合計		18,326,042,554

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益 (円)
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,150,728,600	-	55,951,400
			2,206,680,000	
合計		2,150,728,600	-	55,951,400

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	8,900	3,790.00	33,731,000	
日本水産	255,800	579.00	148,108,200	
マルハニチロ	36,500	2,532.00	92,418,000	
雪国まいたけ	20,100	1,007.00	20,240,700	
カネコ種苗	7,800	1,623.00	12,659,400	
サカタのタネ	29,900	4,935.00	147,556,500	
ホクト	21,000	1,932.00	40,572,000	
ホクリヨウ	3,700	614.00	2,271,800	
住石ホールディングス	48,200	230.00	11,086,000	
日鉄鉱業	5,300	5,760.00	30,528,000	
三井松島ホールディングス	11,500	3,600.00	41,400,000	
I N P E X	873,500	1,538.00	1,343,443,000	
石油資源開発	32,400	3,770.00	122,148,000	
K & O エナジーグループ	10,700	1,527.00	16,338,900	
ショーボンドホールディングス	32,200	6,300.00	202,860,000	
ミライト・ワン	88,700	1,618.00	143,516,600	
タマホーム	16,700	2,420.00	40,414,000	
サンヨーホームズ	3,200	706.00	2,259,200	
日本アクア	10,900	629.00	6,856,100	
ファーストコーポレーション	6,700	741.00	4,964,700	
ベステラ	5,600	1,142.00	6,395,200	
R o b o t H o m e	40,200	194.00	7,798,800	
キャンディル	4,100	577.00	2,365,700	
ダイセキ環境ソリューション	5,300	937.00	4,966,100	
第一カッター興業	6,000	1,329.00	7,974,000	
安藤・間	125,400	895.00	112,233,000	
東急建設	74,000	647.00	47,878,000	
コムシスホールディングス	88,800	2,643.00	234,698,400	
ビーアールホールディングス	34,600	356.00	12,317,600	
高松コンストラクショングループ	17,500	1,958.00	34,265,000	

東建コーポレーション	7,600	9,210.00	69,996,000
ソネック	2,800	1,020.00	2,856,000
ヤマウラ	12,000	975.00	11,700,000
オリエンタル白石	92,600	254.00	23,520,400
大成建設	177,100	4,100.00	726,110,000
大林組	590,800	964.00	569,531,200
清水建設	546,400	766.00	418,542,400
飛島建設	17,000	1,095.00	18,615,000
長谷工コーポレーション	170,500	1,601.00	272,970,500
松井建設	21,200	611.00	12,953,200
銭高組	2,300	3,420.00	7,866,000
鹿島建設	432,900	1,480.00	640,692,000
不動テトラ	13,500	1,593.00	21,505,500
大末建設	6,700	1,491.00	9,989,700
鉄建建設	12,800	1,796.00	22,988,800
西松建設	38,500	3,970.00	152,845,000
三井住友建設	143,500	457.00	65,579,500
大豊建設	9,300	4,185.00	38,920,500
佐田建設	13,700	438.00	6,000,600
ナカノフドー建設	15,200	305.00	4,636,000
奥村組	31,700	2,973.00	94,244,100
東鉄工業	25,000	2,315.00	57,875,000
イチケン	4,600	1,813.00	8,339,800
富士ピー・エス	8,200	461.00	3,780,200
浅沼組	14,200	2,812.00	39,930,400
戸田建設	243,900	703.00	171,461,700
熊谷組	31,500	2,726.00	85,869,000
北野建設	3,900	2,096.00	8,174,400
植木組	5,200	1,321.00	6,869,200
矢作建設工業	25,300	789.00	19,961,700
ピーエス三菱	20,900	648.00	13,543,200
日本ハウスホールディングス	32,800	427.00	14,005,600
大東建託	65,100	13,540.00	881,454,000
新日本建設	27,100	731.00	19,810,100
東亜道路工業	3,300	5,900.00	19,470,000
日本道路	5,500	6,260.00	34,430,000
東亜建設工業	14,200	2,458.00	34,903,600
日本国土開発	49,500	616.00	30,492,000
若築建設	9,800	2,423.00	23,745,400
東洋建設	71,300	860.00	61,318,000
五洋建設	234,200	736.00	172,371,200
世紀東急工業	29,000	776.00	22,504,000

福田組	6,200	5,000.00	31,000,000
住友林業	126,700	2,436.00	308,641,200
日本基礎技術	15,500	558.00	8,649,000
巴コーポレーション	23,100	452.00	10,441,200
大和ハウス工業	503,600	3,215.00	1,619,074,000
ライト工業	35,000	1,853.00	64,855,000
積水ハウス	603,800	2,384.00	1,439,459,200
日特建設	13,100	907.00	11,881,700
北陸電気工事	11,300	773.00	8,734,900
ユアテック	36,400	752.00	27,372,800
日本リーテック	12,100	865.00	10,466,500
四電工	6,100	1,868.00	11,394,800
中電工	25,600	2,146.00	54,937,600
関電工	103,500	844.00	87,354,000
きんでん	129,200	1,520.00	196,384,000
東京エネシス	18,800	994.00	18,687,200
トーエネック	6,400	3,725.00	23,840,000
住友電設	15,700	2,740.00	43,018,000
日本電設工業	27,100	1,800.00	48,780,000
エクシオグループ	88,300	2,157.00	190,463,100
新日本空調	13,800	1,845.00	25,461,000
九電工	40,200	2,870.00	115,374,000
三機工業	41,300	1,633.00	67,442,900
日揮ホールディングス	179,700	1,845.00	331,546,500
中外炉工業	5,900	1,670.00	9,853,000
ヤマト	15,300	782.00	11,964,600
太平電業	11,500	3,480.00	40,020,000
高砂熱学工業	48,700	1,680.00	81,816,000
三晃金属工業	2,500	2,670.00	6,675,000
朝日工業社	7,700	1,935.00	14,899,500
明星工業	32,000	725.00	23,200,000
大気社	26,500	3,315.00	87,847,500
ダイダン	11,900	2,222.00	26,441,800
日比谷総合設備	17,300	1,897.00	32,818,100
フィル・カンパニー	2,900	1,240.00	3,596,000
テスホールディングス	17,800	1,120.00	19,936,000
インフロニア・ホールディングス	221,500	1,005.00	222,607,500
東洋エンジニアリング	26,700	720.00	19,224,000
レイズネクスト	27,300	1,243.00	33,933,900
ニッポン	49,700	1,595.00	79,271,500
日清製粉グループ本社	191,700	1,613.00	309,212,100
日東富士製粉	3,000	4,795.00	14,385,000

昭和産業	16,100	2,625.00	42,262,500
鳥越製粉	14,800	670.00	9,916,000
中部飼料	21,000	1,097.00	23,037,000
フィード・ワン	24,200	715.00	17,303,000
東洋精糖	3,400	915.00	3,111,000
日本甜菜製糖	10,600	1,661.00	17,606,600
D M三井製糖ホールディングス	16,400	1,891.00	31,012,400
塩水港精糖	24,300	207.00	5,030,100
日新製糖	9,600	1,788.00	17,164,800
森永製菓	41,000	4,120.00	168,920,000
中村屋	4,100	3,150.00	12,915,000
江崎グリコ	47,400	3,720.00	176,328,000
名糖産業	7,300	1,688.00	12,322,400
井村屋グループ	9,900	2,274.00	22,512,600
不二家	11,400	2,387.00	27,211,800
山崎製パン	111,000	1,669.00	185,259,000
第一屋製パン	3,500	482.00	1,687,000
モロゾフ	6,000	3,675.00	22,050,000
亀田製菓	10,500	4,620.00	48,510,000
寿スピリッツ	17,600	7,830.00	137,808,000
カルビー	92,800	2,812.00	260,953,600
森永乳業	34,500	4,445.00	153,352,500
六甲バター	12,200	1,439.00	17,555,800
ヤクルト本社	129,300	8,250.00	1,066,725,000
明治ホールディングス	112,200	6,790.00	761,838,000
雪印メグミルク	44,600	1,794.00	80,012,400
プリマハム	25,500	2,226.00	56,763,000
日本ハム	71,300	4,055.00	289,121,500
林兼産業	6,200	478.00	2,963,600
丸大食品	18,400	1,597.00	29,384,800
S Foods	18,300	3,060.00	55,998,000
柿安本店	7,100	2,342.00	16,628,200
伊藤ハム米久ホールディングス	128,900	679.00	87,523,100
サッポロホールディングス	54,600	3,085.00	168,441,000
アサヒグループホールディングス	383,200	4,803.00	1,840,509,600
キリンホールディングス	748,500	2,262.00	1,693,107,000
宝ホールディングス	113,200	1,094.00	123,840,800
オエノンホールディングス	49,600	293.00	14,532,800
養命酒製造	5,500	1,831.00	10,070,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,900	1,469.00	190,823,100
サントリー食品インターナショナル	116,800	5,160.00	602,688,000
ダイドーグループホールディングス	10,400	4,970.00	51,688,000

伊藤園	61,800	6,240.00	385,632,000
キーコーヒー	18,600	2,178.00	40,510,800
ユニカフェ	6,100	926.00	5,648,600
ジャパンフーズ	2,900	1,119.00	3,245,100
日清オイリオグループ	23,400	3,325.00	77,805,000
不二製油グループ本社	44,100	2,409.00	106,236,900
かどや製油	1,800	3,580.00	6,444,000
J - オイルミルズ	19,000	1,627.00	30,913,000
キッコーマン	122,100	8,950.00	1,092,795,000
味の素	405,900	3,774.00	1,531,866,600
ブルドックソース	7,300	1,901.00	13,877,300
キューピー	89,100	2,306.00	205,464,600
ハウス食品グループ本社	63,500	2,978.00	189,103,000
カゴメ	77,300	3,165.00	244,654,500
焼津水産化学工業	8,200	875.00	7,175,000
アリアケジャパン	18,600	4,920.00	91,512,000
ピエトロ	2,700	1,788.00	4,827,600
エバラ食品工業	4,500	3,185.00	14,332,500
やまみ	1,800	1,449.00	2,608,200
ニチレイ	76,000	2,526.00	191,976,000
東洋水産	90,800	5,650.00	513,020,000
イトアンドホールディングス	7,700	2,340.00	18,018,000
大冷	2,300	1,895.00	4,358,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,500	509.00	5,344,500
日清食品ホールディングス	65,700	10,070.00	661,599,000
永谷園ホールディングス	9,000	2,041.00	18,369,000
一正蒲鉾	7,900	801.00	6,327,900
フジッコ	18,900	1,947.00	36,798,300
ロック・フィールド	20,200	1,595.00	32,219,000
日本たばこ産業	1,091,900	2,385.00	2,604,181,500
ケンコーマヨネーズ	10,400	1,532.00	15,932,800
わらべや日洋ホールディングス	12,200	2,274.00	27,742,800
なとり	11,400	2,075.00	23,655,000
イフジ産業	3,500	923.00	3,230,500
ピクルスコーポレーション	9,700	1,170.00	11,349,000
ファーマフーズ	25,600	1,521.00	38,937,600
ユーグレナ	106,800	1,024.00	109,363,200
紀文食品	15,800	997.00	15,752,600
ミヨシ油脂	6,500	1,013.00	6,584,500
理研ビタミン	14,300	1,743.00	24,924,900
片倉工業	15,800	2,036.00	32,168,800
ゲンゼ	11,700	3,925.00	45,922,500

東洋紡	79,100	1,052.00	83,213,200
ユニチカ	57,000	233.00	13,281,000
富士紡ホールディングス	8,300	3,545.00	29,423,500
倉敷紡績	14,100	2,116.00	29,835,600
シキボウ	10,400	913.00	9,495,200
日本毛織	49,600	1,042.00	51,683,200
トーア紡コーポレーション	7,300	367.00	2,679,100
帝国繊維	19,400	1,593.00	30,904,200
帝人	175,000	1,471.00	257,425,000
東レ	1,234,000	778.40	960,545,600
住江織物	3,400	1,774.00	6,031,600
日本フェルト	12,600	421.00	5,304,600
イチカワ	2,800	1,391.00	3,894,800
日東製網	2,100	1,365.00	2,866,500
アツギ	14,700	428.00	6,291,600
ダイニック	6,400	630.00	4,032,000
セーレン	36,900	2,133.00	78,707,700
ソトー	7,500	786.00	5,895,000
東海染工	2,500	1,132.00	2,830,000
小松マテーレ	30,100	952.00	28,655,200
ワコールホールディングス	40,700	2,248.00	91,493,600
ホギメディカル	24,800	3,615.00	89,652,000
T S Iホールディングス	60,900	380.00	23,142,000
マツオカコーポレーション	6,000	923.00	5,538,000
ワールド	26,200	1,374.00	35,998,800
三陽商会	8,700	887.00	7,716,900
ナイガイ	7,600	265.00	2,014,000
オンワードホールディングス	110,300	271.00	29,891,300
ルックホールディングス	5,500	1,700.00	9,350,000
ゴールドウイン	32,900	8,690.00	285,901,000
デサント	34,000	3,595.00	122,230,000
キング	9,800	457.00	4,478,600
ヤマトインターナショナル	15,600	280.00	4,368,000
特種東海製紙	10,300	3,265.00	33,629,500
王子ホールディングス	766,800	560.00	429,408,000
日本製紙	80,600	919.00	74,071,400
三菱製紙	25,400	302.00	7,670,800
北越コーポレーション	118,500	757.00	89,704,500
中越パルプ工業	7,600	957.00	7,273,200
巴川製紙所	5,900	757.00	4,466,300
大王製紙	85,200	1,346.00	114,679,200
阿波製紙	4,500	302.00	1,359,000

レンゴー	153,700	822.00	126,341,400
トーモク	9,700	1,518.00	14,724,600
ザ・バック	12,500	2,378.00	29,725,000
北の達人コーポレーション	71,100	226.00	16,068,600
クラレ	268,200	1,076.00	288,583,200
旭化成	1,229,300	1,035.00	1,272,325,500
共和レザー	10,800	560.00	6,048,000
昭和電工	163,100	2,198.00	358,493,800
住友化学	1,355,600	561.00	760,491,600
住友精化	7,900	3,180.00	25,122,000
日産化学	89,400	7,220.00	645,468,000
ラサ工業	7,000	2,440.00	17,080,000
クレハ	14,400	9,760.00	140,544,000
多木化学	6,600	5,050.00	33,330,000
テイカ	11,300	1,270.00	14,351,000
石原産業	35,600	1,034.00	36,810,400
片倉コープアグリ	4,500	1,213.00	5,458,500
日本曹達	21,800	4,490.00	97,882,000
東ソー	245,700	1,798.00	441,768,600
トクヤマ	59,000	1,816.00	107,144,000
セントラル硝子	29,800	3,495.00	104,151,000
東亜合成	86,800	1,107.00	96,087,600
大阪ソーダ	15,200	3,815.00	57,988,000
関東電化工業	36,200	1,002.00	36,272,400
デンカ	66,900	3,305.00	221,104,500
信越化学工業	315,000	17,125.00	5,394,375,000
日本カーバイド工業	7,100	1,339.00	9,506,900
堺化学工業	12,900	1,974.00	25,464,600
第一稀元素化学工業	16,900	1,361.00	23,000,900
エア・ウォーター	159,200	1,751.00	278,759,200
日本酸素ホールディングス	163,700	2,554.00	418,089,800
日本化学工業	5,600	2,154.00	12,062,400
東邦アセチレン	4,000	1,156.00	4,624,000
日本パーカライズニング	83,500	994.00	82,999,000
高压ガス工業	28,000	670.00	18,760,000
チタン工業	2,300	1,667.00	3,834,100
四国化成工業	23,000	1,245.00	28,635,000
戸田工業	4,200	2,684.00	11,272,800
ステラ ケミファ	10,000	2,686.00	26,860,000
保土谷化学工業	5,300	3,360.00	17,808,000
日本触媒	28,300	5,470.00	154,801,000
大日精化工業	14,100	1,796.00	25,323,600

カネカ	42,800	3,665.00	156,862,000
三菱瓦斯化学	156,400	2,041.00	319,212,400
三井化学	154,700	2,996.00	463,481,200
J S R	185,200	3,250.00	601,900,000
東京応化工業	29,500	7,090.00	209,155,000
大阪有機化学工業	12,700	2,597.00	32,981,900
三菱ケミカルグループ	1,233,500	740.60	913,530,100
K Hネオケム	28,100	2,505.00	70,390,500
ダイセル	267,200	868.00	231,929,600
住友ベークライト	28,100	4,365.00	122,656,500
積水化学工業	379,600	1,948.00	739,460,800
日本ゼオン	149,300	1,366.00	203,943,800
アイカ工業	46,800	3,190.00	149,292,000
U B E	93,700	2,074.00	194,333,800
積水樹脂	27,300	1,722.00	47,010,600
タキロンシーアイ	43,000	544.00	23,392,000
旭有機材	11,200	2,285.00	25,592,000
ニチバン	10,500	1,631.00	17,125,500
リケンテクノス	40,400	508.00	20,523,200
大倉工業	7,800	1,888.00	14,726,400
積水化成成品工業	23,700	412.00	9,764,400
群栄化学工業	4,000	2,528.00	10,112,000
タイガースポリマー	9,500	434.00	4,123,000
ミライアル	6,400	1,910.00	12,224,000
ダイキアクシス	6,900	696.00	4,802,400
ダイキョーニシカワ	41,900	603.00	25,265,700
竹本容器	6,300	755.00	4,756,500
森六ホールディングス	9,600	1,754.00	16,838,400
恵和	5,500	3,755.00	20,652,500
日本化薬	139,600	1,245.00	173,802,000
カーリットホールディングス	16,700	663.00	11,072,100
日本精化	12,800	1,981.00	25,356,800
扶桑化学工業	15,700	3,465.00	54,400,500
トリケミカル研究所	20,500	2,407.00	49,343,500
A D E K A	78,400	2,383.00	186,827,200
日油	57,400	5,230.00	300,202,000
新日本理化	28,200	252.00	7,106,400
ハリマ化成グループ	13,100	900.00	11,790,000
花王	418,900	6,199.00	2,596,761,100
第一工業製薬	6,700	2,173.00	14,559,100
石原ケミカル	9,200	1,346.00	12,383,200
日華化学	7,500	852.00	6,390,000

ニイタカ	3,700	2,520.00	9,324,000
三洋化成工業	11,900	4,775.00	56,822,500
有機合成薬品工業	13,800	326.00	4,498,800
大日本塗料	22,500	749.00	16,852,500
日本ペイントホールディングス	746,600	1,083.00	808,567,800
関西ペイント	171,700	2,184.00	374,992,800
神東塗料	15,600	147.00	2,293,200
中国塗料	43,000	910.00	39,130,000
日本特殊塗料	11,900	964.00	11,471,600
藤倉化成	24,700	474.00	11,707,800
太陽ホールディングス	29,300	2,835.00	83,065,500
D I C	65,900	2,493.00	164,288,700
サカタインクス	37,500	957.00	35,887,500
東洋インキS Cホールディングス	33,000	1,928.00	63,624,000
T & K T O K A	16,100	945.00	15,214,500
富士フィルムホールディングス	356,600	7,476.00	2,665,941,600
資生堂	352,800	5,432.00	1,916,409,600
ライオン	202,700	1,606.00	325,536,200
高砂香料工業	11,400	2,898.00	33,037,200
マンダム	39,500	1,552.00	61,304,000
ミルボン	25,000	5,930.00	148,250,000
ファンケル	82,100	2,742.00	225,118,200
コーセー	34,400	13,720.00	471,968,000
コタ	14,100	1,578.00	22,249,800
シーボン	2,600	1,680.00	4,368,000
ポーラ・オルビスホールディングス	86,600	1,540.00	133,364,000
ノエビアホールディングス	15,100	5,980.00	90,298,000
アジュバンホールディングス	4,600	969.00	4,457,400
新日本製薬	9,600	1,674.00	16,070,400
エステー	13,000	1,575.00	20,475,000
アグロ カネショウ	6,800	1,426.00	9,696,800
コニシ	30,800	1,638.00	50,450,400
長谷川香料	35,000	3,100.00	108,500,000
星光P M C	9,500	583.00	5,538,500
小林製薬	51,700	8,260.00	427,042,000
荒川化学工業	14,300	1,052.00	15,043,600
メック	13,900	2,556.00	35,528,400
日本高純度化学	4,800	2,387.00	11,457,600
タカラバイオ	53,100	2,027.00	107,633,700
J C U	20,800	3,365.00	69,992,000
新田ゼラチン	11,600	711.00	8,247,600
O A T アグリオ	7,700	1,502.00	11,565,400

デクセリアルズ	52,800	4,050.00	213,840,000
アース製薬	15,300	5,360.00	82,008,000
北興化学工業	17,000	1,018.00	17,306,000
大成ラミック	5,300	2,840.00	15,052,000
クミアイ化学工業	67,100	1,049.00	70,387,900
日本農薬	36,100	787.00	28,410,700
アキレス	13,000	1,408.00	18,304,000
有沢製作所	27,600	1,279.00	35,300,400
日東電工	122,600	8,960.00	1,098,496,000
レック	24,000	771.00	18,504,000
三光合成	23,200	417.00	9,674,400
きもと	31,100	253.00	7,868,300
藤森工業	15,800	3,580.00	56,564,000
前澤化成工業	11,900	1,323.00	15,743,700
未来工業	7,300	1,560.00	11,388,000
ウェーブロックホールディングス	7,700	637.00	4,904,900
J S P	11,900	1,475.00	17,552,500
エフピコ	37,300	3,480.00	129,804,000
天馬	15,900	2,351.00	37,380,900
信越ポリマー	36,400	1,379.00	50,195,600
東リ	46,300	205.00	9,491,500
ニフコ	67,700	3,295.00	223,071,500
バルカー	16,500	2,735.00	45,127,500
ユニ・チャーム	352,000	4,939.00	1,738,528,000
ショーエイコーポレーション	5,400	584.00	3,153,600
協和キリン	204,100	3,105.00	633,730,500
武田薬品工業	1,594,700	3,834.00	6,114,079,800
アステラス製薬	1,734,700	2,041.50	3,541,390,050
住友ファーマ	125,300	1,068.00	133,820,400
塩野義製薬	235,500	6,988.00	1,645,674,000
わかもと製薬	19,800	244.00	4,831,200
日本新薬	44,300	7,800.00	345,540,000
中外製薬	528,800	3,820.00	2,020,016,000
科研製薬	28,900	3,905.00	112,854,500
エーザイ	224,200	5,824.00	1,305,740,800
ロート製薬	96,700	4,255.00	411,458,500
小野薬品工業	391,100	3,447.00	1,348,121,700
久光製薬	42,900	3,455.00	148,219,500
持田製薬	22,800	3,445.00	78,546,000
参天製薬	353,400	1,025.00	362,235,000
扶桑薬品工業	6,500	2,126.00	13,819,000
日本ケミファ	2,100	1,892.00	3,973,200

ツムラ	58,000	3,290.00	190,820,000
日医工	57,200	349.00	19,962,800
キッセイ薬品工業	29,400	2,443.00	71,824,200
生化学工業	35,800	903.00	32,327,400
栄研化学	30,200	1,913.00	57,772,600
鳥居薬品	9,100	3,080.00	28,028,000
JCRファーマ	57,200	2,335.00	133,562,000
東和薬品	29,200	2,326.00	67,919,200
富士製薬工業	10,900	1,031.00	11,237,900
ゼリア新薬工業	30,100	2,166.00	65,196,600
第一三共	1,471,800	4,074.00	5,996,113,200
キョーリン製薬ホールディングス	36,600	1,771.00	64,818,600
大幸薬品	30,600	626.00	19,155,600
ダイト	12,700	2,756.00	35,001,200
大塚ホールディングス	386,500	4,740.00	1,832,010,000
大正製薬ホールディングス	37,500	5,200.00	195,000,000
ペプチドリーム	81,900	1,681.00	137,673,900
あすか製薬ホールディングス	19,300	1,256.00	24,240,800
サワイグループホールディングス	38,900	4,270.00	166,103,000
日本コークス工業	171,400	104.00	17,825,600
ニチレキ	22,000	1,388.00	30,536,000
ユシロ化学工業	9,600	884.00	8,486,400
ビーピー・カストロール	7,200	1,107.00	7,970,400
富士石油	44,300	342.00	15,150,600
MORESCO	6,700	1,182.00	7,919,400
出光興産	206,400	3,605.00	744,072,000
ENEOSホールディングス	3,052,200	524.90	1,602,099,780
コスモエネルギーホールディングス	80,100	4,170.00	334,017,000
横浜ゴム	96,100	2,297.00	220,741,700
TOYO TIRE	97,100	1,723.00	167,303,300
ブリヂストン	539,500	5,460.00	2,945,670,000
住友ゴム工業	165,700	1,206.00	199,834,200
藤倉コンポジット	16,200	1,030.00	16,686,000
オカモト	9,400	3,950.00	37,130,000
フコク	8,900	1,010.00	8,989,000
ニッタ	19,100	2,934.00	56,039,400
住友理工	39,300	586.00	23,029,800
三ツ星ベルト	24,600	3,295.00	81,057,000
バンドー化学	32,700	1,011.00	33,059,700
日東紡績	25,200	2,579.00	64,990,800
AGC	171,900	4,935.00	848,326,500
日本板硝子	91,700	528.00	48,417,600

石塚硝子	3,300	1,666.00	5,497,800
日本山村硝子	7,200	678.00	4,881,600
日本電気硝子	69,000	2,605.00	179,745,000
オハラ	8,100	1,347.00	10,910,700
住友大阪セメント	30,300	3,530.00	106,959,000
太平洋セメント	115,300	2,071.00	238,786,300
日本ヒューム	16,800	697.00	11,709,600
日本コンクリート工業	36,900	272.00	10,036,800
三谷セキサン	8,300	3,595.00	29,838,500
アジアパイルホールディングス	29,100	509.00	14,811,900
東海カーボン	141,800	1,024.00	145,203,200
日本カーボン	9,700	4,145.00	40,206,500
東洋炭素	10,600	3,230.00	34,238,000
ノリタケカンパニーリミテド	10,300	4,185.00	43,105,500
TOTO	122,700	4,865.00	596,935,500
日本碍子	199,900	1,966.00	393,003,400
日本特殊陶業	141,500	2,899.00	410,208,500
MARUWA	7,000	17,890.00	125,230,000
品川リフラクトリーズ	4,800	3,790.00	18,192,000
黒崎播磨	3,500	4,770.00	16,695,000
ヨータイ	13,000	1,435.00	18,655,000
東京窯業	20,500	279.00	5,719,500
ニッカトー	8,700	491.00	4,271,700
フジインコーポレーテッド	16,300	6,720.00	109,536,000
クニミネ工業	6,500	851.00	5,531,500
エーアンドエーマテリアル	3,600	867.00	3,121,200
ニチアス	42,800	2,400.00	102,720,000
ニチハ	25,900	2,844.00	73,659,600
日本製鉄	838,100	2,143.00	1,796,048,300
神戸製鋼所	349,600	611.00	213,605,600
中山製鋼所	27,900	559.00	15,596,100
合同製鐵	9,800	1,817.00	17,806,600
JFEホールディングス	464,500	1,485.00	689,782,500
東京製鐵	58,700	1,436.00	84,293,200
共英製鋼	19,800	1,460.00	28,908,000
大和工業	32,800	4,940.00	162,032,000
東京鐵鋼	8,300	1,346.00	11,171,800
大阪製鐵	10,700	1,293.00	13,835,100
淀川製鋼所	22,000	2,433.00	53,526,000
丸一鋼管	58,200	2,901.00	168,838,200
モリ工業	4,900	2,764.00	13,543,600
大同特殊鋼	27,400	3,900.00	106,860,000

日本高周波鋼業	7,600	326.00	2,477,600
日本冶金工業	13,700	2,814.00	38,551,800
山陽特殊製鋼	17,200	2,058.00	35,397,600
愛知製鋼	11,300	2,145.00	24,238,500
日立金属	216,200	1,996.00	431,535,200
日本金属	5,100	1,091.00	5,564,100
大太平洋金属	12,400	2,520.00	31,248,000
新日本電工	111,300	383.00	42,627,900
栗本鐵工所	8,300	1,674.00	13,894,200
虹技	2,600	955.00	2,483,000
三菱製鋼	12,900	1,007.00	12,990,300
日亜鋼業	23,100	251.00	5,798,100
日本精線	3,200	4,505.00	14,416,000
エンビプロ・ホールディングス	13,400	909.00	12,180,600
シンニッタン	24,600	219.00	5,387,400
新家工業	4,200	1,767.00	7,421,400
大紀アルミニウム工業所	24,800	1,330.00	32,984,000
日本軽金属ホールディングス	50,800	1,615.00	82,042,000
三井金属鉱業	54,200	3,240.00	175,608,000
東邦亜鉛	10,300	2,361.00	24,318,300
三菱マテリアル	116,000	2,095.00	243,020,000
住友金属鉱山	219,900	4,417.00	971,298,300
D O W Aホールディングス	46,900	5,190.00	243,411,000
古河機械金属	30,700	1,250.00	38,375,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,200	3,075.00	71,340,000
東邦チタニウム	36,000	2,151.00	77,436,000
U A C J	27,400	2,644.00	72,445,600
C Kサンエツ	3,800	4,265.00	16,207,000
古河電気工業	57,900	2,446.00	141,623,400
住友電気工業	700,200	1,619.00	1,133,623,800
フジクラ	223,800	974.00	217,981,200
昭和電線ホールディングス	17,500	1,839.00	32,182,500
東京特殊電線	2,600	2,232.00	5,803,200
タツタ電線	35,600	469.00	16,696,400
カナレ電気	3,100	1,529.00	4,739,900
平河ヒューテック	11,200	1,170.00	13,104,000
リョービ	18,600	1,307.00	24,310,200
アーレスティ	21,600	418.00	9,028,800
アサヒホールディングス	80,400	2,076.00	166,910,400
稲葉製作所	10,200	1,332.00	13,586,400
宮地エンジニアリンググループ	5,700	3,300.00	18,810,000
トーカロ	51,800	1,288.00	66,718,400

アルファCo	7,100	967.00	6,865,700
SUMCO	330,900	1,933.00	639,629,700
川田テクノロジーズ	3,700	3,750.00	13,875,000
RS Technologies	5,700	7,100.00	40,470,000
ジェイテックコーポレーション	2,600	1,849.00	4,807,400
信和	12,400	806.00	9,994,400
東洋製罐グループホールディングス	102,200	1,644.00	168,016,800
ホッカンホールディングス	9,300	1,317.00	12,248,100
コロナ	9,700	842.00	8,167,400
横河ブリッジホールディングス	28,700	1,953.00	56,051,100
駒井ハルテック	3,100	1,689.00	5,235,900
高田機工	1,700	2,415.00	4,105,500
三和ホールディングス	189,200	1,432.00	270,934,400
文化シャッター	59,100	1,058.00	62,527,800
三協立山	23,900	624.00	14,913,600
アルインコ	13,300	908.00	12,076,400
東洋シャッター	4,400	550.00	2,420,000
LIXIL	315,800	2,622.00	828,027,600
日本フィルコン	12,600	487.00	6,136,200
ノーリツ	25,600	1,545.00	39,552,000
長府製作所	18,100	1,984.00	35,910,400
リンナイ	34,700	10,840.00	376,148,000
ダイニチ工業	9,600	642.00	6,163,200
日東精工	25,200	554.00	13,960,800
三洋工業	2,400	1,660.00	3,984,000
岡部	27,900	646.00	18,023,400
ジーテクト	22,100	1,426.00	31,514,600
東プレ	30,600	1,182.00	36,169,200
高周波熱錬	30,900	671.00	20,733,900
東京製綱	12,300	1,037.00	12,755,100
サンコール	17,200	711.00	12,229,200
モリテック スチール	15,600	283.00	4,414,800
パイオラックス	26,400	2,064.00	54,489,600
エイチワン	17,900	623.00	11,151,700
日本発條	169,100	961.00	162,505,100
中央発條	9,700	718.00	6,964,600
アドバネクス	2,600	1,228.00	3,192,800
立川ブラインド工業	7,800	1,086.00	8,470,800
三益半導体工業	15,700	2,231.00	35,026,700
日本ドライケミカル	4,600	1,615.00	7,429,000
日本製綱所	51,600	2,883.00	148,762,800
三浦工業	79,000	3,115.00	246,085,000

タクマ	57,700	1,414.00	81,587,800
ツガミ	41,200	1,287.00	53,024,400
オークマ	19,200	5,410.00	103,872,000
芝浦機械	22,700	3,040.00	69,008,000
アマダ	316,900	1,071.00	339,399,900
アイダエンジニアリング	44,000	905.00	39,820,000
滝澤鉄工所	5,900	1,174.00	6,926,600
F U J I	80,200	2,064.00	165,532,800
牧野フライス製作所	20,400	4,505.00	91,902,000
オーエスジー	81,400	1,948.00	158,567,200
ダイジェット工業	2,400	907.00	2,176,800
旭ダイヤモンド工業	49,400	801.00	39,569,400
D M G 森精機	103,300	1,837.00	189,762,100
ソディック	47,500	813.00	38,617,500
ディスコ	29,600	36,000.00	1,065,600,000
日東工器	9,700	1,639.00	15,898,300
日進工具	15,900	1,163.00	18,491,700
パンチ工業	17,300	445.00	7,698,500
富士ダイス	10,300	635.00	6,540,500
豊和工業	10,600	850.00	9,010,000
ニデックオーケーケー	7,600	1,261.00	9,583,600
東洋機械金属	13,300	575.00	7,647,500
津田駒工業	3,400	509.00	1,730,600
エンシュウ	4,700	779.00	3,661,300
島精機製作所	29,400	2,322.00	68,266,800
オプトラン	25,200	2,265.00	57,078,000
N C ホールディングス	5,700	1,839.00	10,482,300
イワキポンプ	12,900	1,094.00	14,112,600
フリー	17,900	1,050.00	18,795,000
ヤマシンフィルタ	31,800	337.00	10,716,600
日阪製作所	20,800	826.00	17,180,800
やまびこ	27,900	1,154.00	32,196,600
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,635.00	23,264,000
平田機工	8,800	4,685.00	41,228,000
ペガサスミシン製造	20,500	847.00	17,363,500
マルマエ	8,300	2,165.00	17,969,500
タツモ	9,400	1,337.00	12,567,800
ナブテスコ	106,800	3,495.00	373,266,000
三井海洋開発	21,400	1,413.00	30,238,200
レオン自動機	21,600	1,262.00	27,259,200
S M C	59,400	67,060.00	3,983,364,000
ホソカワミクロン	13,100	2,624.00	34,374,400

ユニオンツール	7,500	3,605.00	27,037,500
オイレス工業	26,000	1,541.00	40,066,000
日精エー・エス・ピー機械	7,800	4,195.00	32,721,000
サトーホールディングス	26,500	1,957.00	51,860,500
技研製作所	17,800	3,420.00	60,876,000
日本エアージェット	8,700	1,070.00	9,309,000
カワタ	6,000	923.00	5,538,000
日精樹脂工業	12,900	975.00	12,577,500
オカダアイオン	6,400	1,453.00	9,299,200
ワイエイシーホールディングス	8,100	1,476.00	11,955,600
小松製作所	919,600	2,893.00	2,660,402,800
住友重機械工業	108,500	2,907.00	315,409,500
日立建機	81,400	2,995.00	243,793,000
日工	25,600	638.00	16,332,800
巴工業	7,300	2,460.00	17,958,000
井関農機	16,100	1,276.00	20,543,600
TOWA	17,400	1,935.00	33,669,000
丸山製作所	3,300	1,609.00	5,309,700
北川鉄工所	8,100	1,363.00	11,040,300
ローツェ	10,000	8,760.00	87,600,000
タカキタ	6,400	541.00	3,462,400
クボタ	907,400	2,252.50	2,043,918,500
荏原実業	8,600	2,244.00	19,298,400
三菱化工機	6,100	2,230.00	13,603,000
月島機械	31,900	918.00	29,284,200
帝国電機製作所	12,900	1,913.00	24,677,700
新東工業	38,200	721.00	27,542,200
澁谷工業	16,100	2,547.00	41,006,700
アイチ コーポレーション	29,200	863.00	25,199,600
小森コーポレーション	46,900	789.00	37,004,100
鶴見製作所	14,400	2,126.00	30,614,400
住友精密工業	3,100	2,521.00	7,815,100
日本ギア工業	7,600	303.00	2,302,800
酒井重工業	3,400	2,994.00	10,179,600
荏原製作所	69,600	5,500.00	382,800,000
石井鐵工所	2,500	2,927.00	7,317,500
西島製作所	16,700	1,339.00	22,361,300
北越工業	17,200	974.00	16,752,800
ダイキン工業	221,600	25,135.00	5,569,916,000
オルガノ	5,900	9,470.00	55,873,000
トーヨーカネツ	7,100	2,625.00	18,637,500
栗田工業	102,500	5,650.00	579,125,000

椿本チエイン	26,600	3,210.00	85,386,000
大同工業	8,600	765.00	6,579,000
木村化工機	15,900	704.00	11,193,600
アネスト岩田	31,700	962.00	30,495,400
ダイフク	95,700	8,550.00	818,235,000
サムコ	5,600	3,035.00	16,996,000
加藤製作所	10,000	785.00	7,850,000
油研工業	3,300	1,829.00	6,035,700
タダノ	98,200	983.00	96,530,600
フジテック	62,300	2,855.00	177,866,500
C K D	51,400	1,856.00	95,398,400
キトー	16,000	2,670.00	42,720,000
平和	56,600	2,112.00	119,539,200
理想科学工業	17,100	2,469.00	42,219,900
S A N K Y O	41,800	4,180.00	174,724,000
日本金銭機械	20,700	669.00	13,848,300
マースグループホールディングス	13,000	1,595.00	20,735,000
フクシマガリレイ	12,500	3,715.00	46,437,500
オーイズミ	7,400	409.00	3,026,600
ダイコク電機	9,400	1,299.00	12,210,600
竹内製作所	30,900	2,567.00	79,320,300
アマノ	53,200	2,652.00	141,086,400
J U K I	26,500	717.00	19,000,500
ジャノメ	17,400	716.00	12,458,400
マックス	24,000	2,010.00	48,240,000
グローリー	48,200	2,202.00	106,136,400
新晃工業	18,900	1,615.00	30,523,500
大和冷機工業	26,200	1,168.00	30,601,600
セガサミーホールディングス	182,400	2,136.00	389,606,400
日本ピストンリング	7,500	1,260.00	9,450,000
リケン	7,400	2,455.00	18,167,000
T P R	22,200	1,302.00	28,904,400
ツバキ・ナカシマ	42,000	1,106.00	46,452,000
ホシザキ	109,500	4,200.00	459,900,000
大豊工業	16,700	734.00	12,257,800
日本精工	347,400	777.00	269,929,800
N T N	368,900	273.00	100,709,700
ジェイテクト	173,100	1,023.00	177,081,300
不二越	12,600	3,840.00	48,384,000
日本トムソン	46,500	561.00	26,086,500
T H K	98,200	2,813.00	276,236,600
ユーシン精機	15,900	718.00	11,416,200

前澤給装工業	13,200	921.00	12,157,200
イーグル工業	22,000	1,113.00	24,486,000
前澤工業	12,300	634.00	7,798,200
日本ピラー工業	17,400	2,660.00	46,284,000
キッツ	62,800	785.00	49,298,000
マキタ	229,300	3,356.00	769,530,800
三井E & Sホールディングス	75,700	435.00	32,929,500
日立造船	161,100	856.00	137,901,600
三菱重工業	297,600	4,957.00	1,475,203,200
I H I	126,700	3,475.00	440,282,500
スター精密	32,900	1,818.00	59,812,200
日清紡ホールディングス	138,500	1,073.00	148,610,500
イビデン	97,700	4,580.00	447,466,000
コニカミノルタ	412,900	483.00	199,430,700
ブラザー工業	231,500	2,665.00	616,947,500
ミネベアミツミ	323,100	2,488.00	803,872,800
日立製作所	975,800	6,999.00	6,829,624,200
東芝	354,700	5,262.00	1,866,431,400
三菱電機	1,893,600	1,435.50	2,718,262,800
富士電機	112,900	6,120.00	690,948,000
東洋電機製造	6,700	924.00	6,190,800
安川電機	201,600	4,765.00	960,624,000
シンフォニアテクノロジー	20,600	1,541.00	31,744,600
明電舎	28,700	1,996.00	57,285,200
オリジン	4,600	1,511.00	6,950,600
山洋電気	7,500	5,520.00	41,400,000
デンヨー	14,400	1,623.00	23,371,200
P H C ホールディングス	31,700	1,610.00	51,037,000
東芝テック	21,800	4,435.00	96,683,000
芝浦メカトロニクス	3,700	11,530.00	42,661,000
マブチモーター	42,400	4,010.00	170,024,000
日本電産	450,800	9,811.00	4,422,798,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,400	471.00	3,956,400
トレックス・セミコンダクター	8,900	2,948.00	26,237,200
東光高岳	11,600	1,946.00	22,573,600
ダブル・スコープ	55,600	2,210.00	122,876,000
ダイヘン	18,800	4,030.00	75,764,000
ヤーマン	33,500	1,636.00	54,806,000
J V C ケンウッド	168,300	205.00	34,501,500
ミマキエンジニアリング	19,100	724.00	13,828,400
I - P E X	9,900	1,359.00	13,454,100
日新電機	47,500	1,583.00	75,192,500

大崎電気工業	34,100	577.00	19,675,700
オムロン	168,900	7,633.00	1,289,213,700
日東工業	25,500	2,564.00	65,382,000
I D E C	25,100	2,958.00	74,245,800
正興電機製作所	7,700	1,090.00	8,393,000
不二電機工業	4,300	1,110.00	4,773,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	61,200	2,529.00	154,774,800
サクサホールディングス	4,700	1,296.00	6,091,200
メルコホールディングス	5,800	3,410.00	19,778,000
テクノメディカ	4,900	1,640.00	8,036,000
日本電気	240,600	4,975.00	1,196,985,000
富士通	182,600	17,000.00	3,104,200,000
沖電気工業	76,900	767.00	58,982,300
岩崎通信機	8,300	786.00	6,523,800
電気興業	9,800	2,443.00	23,941,400
サンケン電気	17,400	5,010.00	87,174,000
ナカヨ	3,300	1,082.00	3,570,600
アイホン	9,200	2,035.00	18,722,000
ルネサスエレクトロニクス	1,107,600	1,361.00	1,507,443,600
セイコーエプソン	226,600	2,204.00	499,426,400
ワコム	156,200	873.00	136,362,600
アルバック	40,400	5,450.00	220,180,000
アクセル	8,400	1,006.00	8,450,400
E I Z O	13,800	3,925.00	54,165,000
日本信号	43,000	930.00	39,990,000
京三製作所	39,600	434.00	17,186,400
能美防災	23,400	1,671.00	39,101,400
ホーチキ	13,200	1,352.00	17,846,400
星和電機	8,900	455.00	4,049,500
エレコム	46,800	1,727.00	80,823,600
パナソニック ホールディングス	2,163,900	1,149.00	2,486,321,100
シャープ	192,700	1,034.00	199,251,800
アンリツ	128,300	1,665.00	213,619,500
富士通ゼネラル	55,100	2,896.00	159,569,600
ソニーグループ	1,271,000	11,930.00	15,163,030,000
T D K	294,000	4,965.00	1,459,710,000
帝国通信工業	9,400	1,498.00	14,081,200
タムラ製作所	73,000	676.00	49,348,000
アルプスアルパイン	166,200	1,281.00	212,902,200
池上通信機	6,000	603.00	3,618,000
日本電波工業	20,800	1,378.00	28,662,400
鈴木	10,700	845.00	9,041,500

メイコー	22,100	3,370.00	74,477,000
日本トリム	4,100	2,442.00	10,012,200
ローランド ディー・ジー	9,700	3,535.00	34,289,500
フォスター電機	18,900	869.00	16,424,100
S M K	4,500	2,427.00	10,921,500
ヨコオ	13,800	2,166.00	29,890,800
ホシデン	45,200	1,567.00	70,828,400
ヒロセ電機	28,100	20,040.00	563,124,000
日本航空電子工業	40,700	2,358.00	95,970,600
T O A	21,800	810.00	17,658,000
マクセル	37,400	1,480.00	55,352,000
古野電気	24,700	1,121.00	27,688,700
ユニデンホールディングス	4,400	4,095.00	18,018,000
スミダコーポレーション	16,200	989.00	16,021,800
アイコム	6,500	2,665.00	17,322,500
リオン	7,300	2,150.00	15,695,000
本多通信工業	16,600	703.00	11,669,800
横河電機	186,100	2,413.00	449,059,300
新電元工業	7,200	3,715.00	26,748,000
アズビル	117,700	4,035.00	474,919,500
東亜ディーケーケー	10,800	847.00	9,147,600
日本光電工業	78,000	3,110.00	242,580,000
チノー	6,400	1,679.00	10,745,600
共和電業	17,700	341.00	6,035,700
日本電子材料	9,500	1,652.00	15,694,000
堀場製作所	37,500	6,450.00	241,875,000
アドバンテスト	150,800	8,320.00	1,254,656,000
小野測器	8,400	417.00	3,502,800
エスベック	15,300	1,887.00	28,871,100
キーエンス	183,800	56,270.00	10,342,426,000
日置電機	8,900	6,720.00	59,808,000
シスメックス	145,300	8,871.00	1,288,956,300
日本マイクロニクス	28,200	1,442.00	40,664,400
メガチップス	18,200	2,850.00	51,870,000
O B A R A G R O U P	8,100	3,300.00	26,730,000
澤藤電機	2,900	1,312.00	3,804,800
原田工業	10,400	813.00	8,455,200
コーセル	23,200	884.00	20,508,800
イリソ電子工業	17,200	4,015.00	69,058,000
オブテックスグループ	31,200	2,028.00	63,273,600
千代田インテグレ	7,100	2,206.00	15,662,600
レーザーテック	83,200	20,550.00	1,709,760,000

スタンレー電気	131,000	2,597.00	340,207,000
岩崎電気	6,600	2,608.00	17,212,800
ウシオ電機	96,300	1,795.00	172,858,500
岡谷電機産業	16,900	248.00	4,191,200
ハリオス テクノ ホールディング	18,900	369.00	6,974,100
エノモト	6,000	1,611.00	9,666,000
日本セラミック	17,400	2,544.00	44,265,600
遠藤照明	10,100	750.00	7,575,000
古河電池	15,000	1,163.00	17,445,000
双信電機	11,100	454.00	5,039,400
山一電機	13,500	2,056.00	27,756,000
図研	13,400	3,665.00	49,111,000
日本電子	39,100	5,760.00	225,216,000
カシオ計算機	125,500	1,357.00	170,303,500
ファナック	178,100	23,600.00	4,203,160,000
日本シイエムケイ	37,100	473.00	17,548,300
エンプラス	5,200	4,210.00	21,892,000
大真空	25,700	956.00	24,569,200
ローム	84,400	10,610.00	895,484,000
浜松ホトニクス	135,300	6,130.00	829,389,000
三井ハイテック	17,500	9,050.00	158,375,000
新光電気工業	59,800	4,025.00	240,695,000
京セラ	285,500	7,775.00	2,219,762,500
太陽誘電	90,400	4,480.00	404,992,000
村田製作所	553,500	7,858.00	4,349,403,000
双葉電子工業	35,700	668.00	23,847,600
北陸電気工業	8,100	1,127.00	9,128,700
ニチコン	54,500	1,450.00	79,025,000
日本ケミコン	19,500	1,835.00	35,782,500
K O A	28,300	2,306.00	65,259,800
市光工業	25,900	389.00	10,075,100
小糸製作所	101,400	4,765.00	483,171,000
ミツバ	31,600	423.00	13,366,800
S C R E E Nホールディングス	32,000	9,770.00	312,640,000
キャノン電子	19,000	1,688.00	32,072,000
キャノン	924,200	3,487.00	3,222,685,400
リコー	482,700	1,100.00	530,970,000
象印マホービン	50,700	1,633.00	82,793,100
M U T O Hホールディングス	2,900	1,966.00	5,701,400
東京エレクトロン	128,700	45,680.00	5,879,016,000
トヨタ紡織	70,900	2,082.00	147,613,800
芦森工業	3,800	1,053.00	4,001,400

ユニプレス	33,300	964.00	32,101,200
豊田自動織機	143,700	7,980.00	1,146,726,000
モリタホールディングス	32,500	1,337.00	43,452,500
三櫻工業	28,100	788.00	22,142,800
デンソー	397,100	7,935.00	3,150,988,500
東海理化電機製作所	53,400	1,562.00	83,410,800
川崎重工業	137,500	2,616.00	359,700,000
名村造船所	52,300	680.00	35,564,000
日本車輛製造	6,500	2,179.00	14,163,500
三菱ロジスネクスト	26,900	854.00	22,972,600
近畿車輛	3,000	1,043.00	3,129,000
日産自動車	2,392,800	534.20	1,278,233,760
いすゞ自動車	587,700	1,618.00	950,898,600
トヨタ自動車	9,249,400	2,150.00	19,886,210,000
日野自動車	253,400	629.00	159,388,600
三菱自動車工業	751,000	526.00	395,026,000
エフテック	13,000	524.00	6,812,000
レシップホールディングス	8,000	535.00	4,280,000
G M B	3,700	721.00	2,667,700
ファルテック	3,500	590.00	2,065,000
武蔵精密工業	45,200	1,674.00	75,664,800
日産車体	29,700	764.00	22,690,800
新明和工業	52,900	1,089.00	57,608,100
極東開発工業	32,300	1,422.00	45,930,600
トピー工業	15,200	1,388.00	21,097,600
ティラド	5,500	2,768.00	15,224,000
曙ブレーキ工業	111,400	182.00	20,274,800
タチエス	33,300	1,212.00	40,359,600
N O K	76,300	1,239.00	94,535,700
フタバ産業	45,100	376.00	16,957,600
K Y B	17,800	3,255.00	57,939,000
大同メタル工業	38,900	533.00	20,733,700
プレス工業	90,900	432.00	39,268,800
ミクニ	23,600	328.00	7,740,800
太平洋工業	38,600	1,140.00	44,004,000
河西工業	24,900	245.00	6,100,500
アイシン	148,500	4,300.00	638,550,000
マツダ	597,000	1,250.00	746,250,000
今仙電機製作所	13,300	580.00	7,714,000
本田技研工業	1,483,400	3,723.00	5,522,698,200
スズキ	402,200	4,870.00	1,958,714,000
S U B A R U	533,000	2,484.00	1,323,972,000

安永	8,200	690.00	5,658,000
ヤマハ発動機	264,700	2,876.00	761,277,200
T B K	20,400	325.00	6,630,000
エクセディ	30,600	1,850.00	56,610,000
豊田合成	57,300	2,403.00	137,691,900
愛三工業	31,800	739.00	23,500,200
盟和産業	2,900	989.00	2,868,100
日本プラスト	14,700	463.00	6,806,100
ヨロズ	15,800	901.00	14,235,800
エフ・シー・シー	33,200	1,498.00	49,733,600
シマノ	68,900	25,115.00	1,730,423,500
テイ・エス テック	85,700	1,634.00	140,033,800
ジャムコ	11,800	1,239.00	14,620,200
テルモ	574,100	4,603.00	2,642,582,300
クリエートメディック	6,100	943.00	5,752,300
日機装	42,100	1,020.00	42,942,000
日本エム・ディ・エム	11,700	1,410.00	16,497,000
島津製作所	242,500	4,400.00	1,067,000,000
J M S	15,600	582.00	9,079,200
長野計器	13,500	1,128.00	15,228,000
ブイ・テクノロジー	8,900	3,005.00	26,744,500
東京計器	12,900	1,310.00	16,899,000
愛知時計電機	7,300	1,472.00	10,745,600
インターアクション	10,200	1,786.00	18,217,200
オーバル	18,200	503.00	9,154,600
東京精密	31,700	4,715.00	149,465,500
マニー	74,100	1,792.00	132,787,200
ニコン	286,000	1,616.00	462,176,000
トプコン	95,400	1,824.00	174,009,600
オリンパス	972,000	3,079.00	2,992,788,000
理研計器	13,400	4,460.00	59,764,000
タムロン	12,600	3,085.00	38,871,000
H O Y A	391,700	14,855.00	5,818,703,500
シード	9,500	552.00	5,244,000
ノーリツ鋼機	16,000	2,505.00	40,080,000
A & D ホロンホールディングス	22,800	933.00	21,272,400
朝日インテック	222,500	2,579.00	573,827,500
シチズン時計	198,100	608.00	120,444,800
リズム	6,400	1,470.00	9,408,000
大研医器	16,100	470.00	7,567,000
メニコン	62,600	3,520.00	220,352,000
シンシア	1,800	482.00	867,600

松風	6,800	2,117.00	14,395,600
セイコーホールディングス	28,700	2,879.00	82,627,300
ニプロ	140,400	1,124.00	157,809,600
中本パックス	5,700	1,612.00	9,188,400
スノーピーク	28,800	2,302.00	66,297,600
パラマウントベッドホールディングス	38,900	2,697.00	104,913,300
トランザクション	13,000	1,145.00	14,885,000
粧美堂	5,100	405.00	2,065,500
ニホンフラッシュ	15,800	968.00	15,294,400
前田工織	18,300	3,020.00	55,266,000
永大産業	22,100	257.00	5,679,700
アートネイチャー	17,300	757.00	13,096,100
バンダイナムコホールディングス	167,800	10,865.00	1,823,147,000
アイフィスジャパン	5,200	595.00	3,094,000
共立印刷	27,800	150.00	4,170,000
SHOEI	17,800	5,670.00	100,926,000
フランスベッドホールディングス	26,100	945.00	24,664,500
パイロットコーポレーション	26,300	5,170.00	135,971,000
萩原工業	11,300	1,142.00	12,904,600
フジシールインターナショナル	41,700	1,580.00	65,886,000
タカラトミー	83,800	1,367.00	114,554,600
広済堂ホールディングス	12,600	1,091.00	13,746,600
エステールホールディングス	4,300	621.00	2,670,300
タカノ	6,900	746.00	5,147,400
プロネクサス	15,700	1,100.00	17,270,000
ホクシン	14,300	159.00	2,273,700
ウッドワン	6,200	1,096.00	6,795,200
大建工業	10,200	1,964.00	20,032,800
凸版印刷	264,300	2,264.00	598,375,200
大日本印刷	219,800	2,991.00	657,421,800
共同印刷	5,300	2,447.00	12,969,100
NISSHA	32,000	1,838.00	58,816,000
光村印刷	1,600	1,223.00	1,956,800
TAKARA & COMPANY	11,600	2,012.00	23,339,200
アシックス	155,500	2,647.00	411,608,500
ツツミ	5,100	1,958.00	9,985,800
ローランド	12,400	4,375.00	54,250,000
小松ウオール工業	6,200	1,935.00	11,997,000
ヤマハ	118,000	5,660.00	667,880,000
河合楽器製作所	5,100	2,831.00	14,438,100
クリナップ	18,900	633.00	11,963,700
ピジョン	107,300	2,074.00	222,540,200

兼松サステック	1,300	1,634.00	2,124,200
キングジム	14,900	914.00	13,618,600
リンテック	38,600	2,344.00	90,478,400
イトーキ	34,500	419.00	14,455,500
任天堂	114,500	60,050.00	6,875,725,000
三菱鉛筆	24,300	1,450.00	35,235,000
タカラスタンダード	32,600	1,338.00	43,618,800
コクヨ	81,100	1,807.00	146,547,700
ナカバヤシ	16,300	519.00	8,459,700
グローブライド	15,100	2,700.00	40,770,000
オカムラ	57,000	1,314.00	74,898,000
美津濃	16,700	2,667.00	44,538,900
東京電力ホールディングス	1,518,400	508.00	771,347,200
中部電力	573,000	1,411.00	808,503,000
関西電力	709,600	1,293.00	917,512,800
中国電力	292,700	854.00	249,965,800
北陸電力	172,200	519.00	89,371,800
東北電力	443,500	659.00	292,266,500
四国電力	168,600	824.00	138,926,400
九州電力	388,300	846.00	328,501,800
北海道電力	176,300	525.00	92,557,500
沖縄電力	43,000	1,156.00	49,708,000
電源開発	149,900	2,074.00	310,892,600
エフオン	12,300	689.00	8,474,700
イーレックス	26,100	2,768.00	72,244,800
レノバ	39,800	2,803.00	111,559,400
東京瓦斯	361,100	2,740.00	989,414,000
大阪瓦斯	341,200	2,474.00	844,128,800
東邦瓦斯	79,600	3,330.00	265,068,000
北海道瓦斯	10,100	1,622.00	16,382,200
広島ガス	35,500	332.00	11,786,000
西部ガスホールディングス	19,300	1,797.00	34,682,100
静岡ガス	38,400	1,091.00	41,894,400
メタウォーター	21,100	2,046.00	43,170,600
SBSホールディングス	15,000	2,931.00	43,965,000
東武鉄道	185,000	3,295.00	609,575,000
相鉄ホールディングス	60,300	2,443.00	147,312,900
東急	472,300	1,644.00	776,461,200
京浜急行電鉄	225,800	1,426.00	321,990,800
小田急電鉄	255,300	1,938.00	494,771,400
京王電鉄	89,100	5,380.00	479,358,000
京成電鉄	119,500	3,865.00	461,867,500

富士急行	20,700	4,140.00	85,698,000
新京成電鉄	4,700	3,150.00	14,805,000
東日本旅客鉄道	309,500	6,982.00	2,160,929,000
西日本旅客鉄道	215,200	5,195.00	1,117,964,000
東海旅客鉄道	142,700	16,005.00	2,283,913,500
西武ホールディングス	244,500	1,385.00	338,632,500
鴻池運輸	28,700	1,304.00	37,424,800
西日本鉄道	48,700	2,879.00	140,207,300
ハマキョウレックス	13,200	3,215.00	42,438,000
サカイ引越センター	9,300	5,530.00	51,429,000
近鉄グループホールディングス	180,200	4,770.00	859,554,000
阪急阪神ホールディングス	224,200	4,130.00	925,946,000
南海電気鉄道	80,400	2,769.00	222,627,600
京阪ホールディングス	74,900	3,445.00	258,030,500
神戸電鉄	4,600	3,370.00	15,502,000
名古屋鉄道	185,900	2,133.00	396,524,700
山陽電気鉄道	13,700	2,270.00	31,099,000
アルプス物流	13,400	1,185.00	15,879,000
ヤマトホールディングス	263,200	2,249.00	591,936,800
山九	46,700	4,300.00	200,810,000
丸運	9,100	231.00	2,102,100
丸全昭和運輸	13,000	3,245.00	42,185,000
センコーグループホールディングス	89,000	965.00	85,885,000
トナミホールディングス	3,700	3,745.00	13,856,500
ニッコンホールディングス	58,000	2,399.00	139,142,000
日本石油輸送	2,100	2,432.00	5,107,200
福山通運	24,600	3,310.00	81,426,000
セイノーホールディングス	104,700	1,138.00	119,148,600
エスライン	5,200	827.00	4,300,400
神奈川中央交通	4,800	3,680.00	17,664,000
日立物流	37,100	8,770.00	325,367,000
丸和運輸機関	32,500	1,704.00	55,380,000
C & F ロジホールディングス	16,200	1,228.00	19,893,600
九州旅客鉄道	128,800	2,837.00	365,405,600
S Gホールディングス	322,700	2,378.00	767,380,600
NIPPON EXPRESSホールディングス	62,800	7,820.00	491,096,000
日本郵船	160,900	10,710.00	1,723,239,000
商船三井	297,000	3,725.00	1,106,325,000
川崎汽船	59,400	9,370.00	556,578,000
NSユナイテッド海運	9,600	5,050.00	48,480,000
飯野海運	78,300	823.00	64,440,900
共栄タンカー	5,900	916.00	5,404,400

乾汽船	12,600	2,043.00	25,741,800
日本航空	413,000	2,400.00	991,200,000
A N Aホールディングス	457,600	2,561.50	1,172,142,400
パスコ	3,600	1,320.00	4,752,000
トランコム	5,400	7,620.00	41,148,000
日新	14,000	1,838.00	25,732,000
三菱倉庫	46,500	3,680.00	171,120,000
三井倉庫ホールディングス	18,800	3,425.00	64,390,000
住友倉庫	56,400	2,211.00	124,700,400
澁澤倉庫	9,600	2,118.00	20,332,800
東陽倉庫	27,200	284.00	7,724,800
日本トランスシティ	33,800	517.00	17,474,600
ケイヒン	3,300	1,463.00	4,827,900
中央倉庫	9,900	978.00	9,682,200
川西倉庫	3,500	1,059.00	3,706,500
安田倉庫	12,900	943.00	12,164,700
ファイズホールディングス	4,100	902.00	3,698,200
東洋埠頭	5,400	1,241.00	6,701,400
上組	91,300	2,729.00	249,157,700
サンリツ	4,900	700.00	3,430,000
キムラユニティー	10,000	780.00	7,800,000
キューソー流通システム	11,200	1,252.00	14,022,400
東海運	10,900	282.00	3,073,800
エーアイティー	12,100	1,660.00	20,086,000
内外トランスライン	6,100	2,141.00	13,060,100
日本コンセプト	5,200	1,801.00	9,365,200
N E C ネットズエスアイ	66,000	1,815.00	119,790,000
クロスキャット	10,900	1,178.00	12,840,200
システナ	284,600	441.00	125,508,600
デジタルアーツ	10,700	6,940.00	74,258,000
日鉄ソリューションズ	34,700	3,830.00	132,901,000
キューブシステム	10,300	1,029.00	10,598,700
W O W W O R L D	3,000	846.00	2,538,000
コア	8,600	1,506.00	12,951,600
手間いらず	2,900	4,725.00	13,702,500
ラクーンホールディングス	17,100	1,369.00	23,409,900
ソリトンシステムズ	8,900	1,223.00	10,884,700
ソフトクリエイイトホールディングス	8,700	3,855.00	33,538,500
T I S	174,100	4,025.00	700,752,500
J N S ホールディングス	9,800	398.00	3,900,400
グリー	90,900	873.00	79,355,700
G M O ペパボ	2,500	1,979.00	4,947,500

コーエーテックモホールディングス	63,600	4,835.00	307,506,000
三菱総合研究所	8,300	4,150.00	34,445,000
電算	2,300	2,085.00	4,795,500
A G S	8,200	721.00	5,912,200
ファインデックス	13,700	692.00	9,480,400
ブレインパッド	17,100	1,161.00	19,853,100
K L a b	31,600	418.00	13,208,800
ポールトゥウィンホールディングス	29,100	1,048.00	30,496,800
ネクソン	454,600	2,864.00	1,301,974,400
アイスタイル	51,900	624.00	32,385,600
エムアップホールディングス	23,200	1,390.00	32,248,000
エイチーム	12,800	793.00	10,150,400
エニグモ	21,900	572.00	12,526,800
テクノスジャパン	15,900	467.00	7,425,300
コロプラ	65,900	695.00	45,800,500
ブロードリーフ	99,200	507.00	50,294,400
クロス・マーケティンググループ	7,800	906.00	7,066,800
デジタルハーツホールディングス	9,200	1,869.00	17,194,800
システム情報	15,200	995.00	15,124,000
メディアドゥ	6,900	2,082.00	14,365,800
じげん	57,000	334.00	19,038,000
ブイキューブ	20,400	1,290.00	26,316,000
エンカレッジ・テクノロジー	4,800	523.00	2,510,400
サイバーリンクス	6,200	1,191.00	7,384,200
フィックスターズ	19,300	1,139.00	21,982,700
C A R T A H O L D I N G S	8,300	1,800.00	14,940,000
オブティム	14,200	894.00	12,694,800
セレス	6,900	1,222.00	8,431,800
S H I F T	12,400	20,540.00	254,696,000
ティーガイア	17,800	1,659.00	29,530,200
セック	3,000	2,321.00	6,963,000
テクマトリックス	33,800	1,828.00	61,786,400
プロシップ	6,700	1,438.00	9,634,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	51,800	2,370.00	122,766,000
G M O ペイメントゲートウェイ	38,600	11,050.00	426,530,000
ザッパラス	7,500	313.00	2,347,500
システムリサーチ	5,900	2,013.00	11,876,700
インターネットイニシアティブ	53,100	5,150.00	273,465,000
さくらインターネット	21,700	587.00	12,737,900
ヴィンクス	5,700	1,500.00	8,550,000
G M O グローバルサイン・ホールディングス	5,200	5,200.00	27,040,000
S R A ホールディングス	9,700	3,020.00	29,294,000

システムインテグレータ	6,800	461.00	3,134,800
朝日ネット	18,500	635.00	11,747,500
e B A S E	24,200	584.00	14,132,800
アバント	21,500	1,445.00	31,067,500
アドソル日進	7,200	1,631.00	11,743,200
ODKソリューションズ	4,500	584.00	2,628,000
フリービット	10,600	888.00	9,412,800
コムチュア	22,400	2,399.00	53,737,600
サイバーコム	3,200	1,219.00	3,900,800
アステリア	14,600	823.00	12,015,800
アイル	9,600	1,745.00	16,752,000
マークライنز	9,300	2,229.00	20,729,700
メディカル・データ・ビジョン	25,400	1,215.00	30,861,000
g u m i	27,900	744.00	20,757,600
ショーケース	4,900	412.00	2,018,800
モバイルファクトリー	4,200	1,006.00	4,225,200
テラスカイ	7,400	1,854.00	13,719,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,000	1,413.00	12,717,000
P C Iホールディングス	8,000	981.00	7,848,000
アイビーシー	3,400	408.00	1,387,200
ネオジャパン	5,800	1,142.00	6,623,600
P R T I M E S	4,300	2,460.00	10,578,000
ラクス	91,400	1,752.00	160,132,800
ランドコンピュータ	4,800	878.00	4,214,400
ダブルスタンダード	6,100	2,425.00	14,792,500
オープンドア	11,900	1,864.00	22,181,600
マイネット	6,500	512.00	3,328,000
アカツキ	9,000	2,510.00	22,590,000
ベネフィットジャパン	1,600	1,603.00	2,564,800
U b i c o mホールディングス	5,300	2,632.00	13,949,600
カナミックネットワーク	24,700	567.00	14,004,900
ノムラシステムコーポレーション	19,400	125.00	2,425,000
チェンジ	41,500	1,860.00	77,190,000
シンクロ・フード	10,700	432.00	4,622,400
オークネット	8,900	2,217.00	19,731,300
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	679.00	2,648,100
セグエグループ	5,600	629.00	3,522,400
エイトレッド	2,900	1,868.00	5,417,200
マクロミル	38,500	1,069.00	41,156,500
ビーグリー	3,300	1,351.00	4,458,300
オロ	5,200	1,605.00	8,346,000
ユーザーローカル	6,200	1,624.00	10,068,800

テモナ	4,300	319.00	1,371,700
ニーズウェル	6,100	648.00	3,952,800
マネーフォワード	40,600	3,580.00	145,348,000
サインポスト	6,400	836.00	5,350,400
電算システムホールディングス	8,300	2,443.00	20,276,900
ソルクシーズ	15,800	371.00	5,861,800
フェイス	5,600	580.00	3,248,000
プロトコーポレーション	21,300	1,168.00	24,878,400
ハイマックス	5,400	1,369.00	7,392,600
野村総合研究所	346,300	3,955.00	1,369,616,500
サイバネットシステム	14,400	976.00	14,054,400
C Eホールディングス	10,100	506.00	5,110,600
日本システム技術	3,600	2,470.00	8,892,000
インテージホールディングス	23,100	1,608.00	37,144,800
東邦システムサイエンス	5,500	1,002.00	5,511,000
ソースネクスト	86,800	241.00	20,918,800
インフォコム	21,900	2,061.00	45,135,900
シンプレクス・ホールディングス	31,600	2,088.00	65,980,800
HEROZ	5,900	898.00	5,298,200
ラクスル	23,900	2,207.00	52,747,300
メルカリ	76,000	2,379.00	180,804,000
I P S	5,600	2,706.00	15,153,600
F I G	22,400	365.00	8,176,000
システムサポート	7,400	1,421.00	10,515,400
イーソル	11,200	641.00	7,179,200
アルテリア・ネットワークス	19,100	1,287.00	24,581,700
東海ソフト	3,300	924.00	3,049,200
ウイングアーク1st	15,300	1,797.00	27,494,100
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,795.00	8,436,500
サーバーワークス	3,500	2,863.00	10,020,500
東名	1,600	1,090.00	1,744,000
ヴィッツ	2,100	1,056.00	2,217,600
トピラシステムズ	4,900	990.00	4,851,000
S a n s a n	63,100	1,369.00	86,383,900
L i n k - U	3,900	732.00	2,854,800
ギフティ	18,300	1,870.00	34,221,000
ベース	2,900	6,430.00	18,647,000
J M D C	25,000	6,960.00	174,000,000
フォーカスシステムズ	12,600	998.00	12,574,800
クレスコ	14,600	1,848.00	26,980,800
フジ・メディア・ホールディングス	177,300	1,119.00	198,398,700
オービック	62,800	21,590.00	1,355,852,000

ジャストシステム	28,400	3,700.00	105,080,000
TDCソフト	16,000	1,220.00	19,520,000
Zホールディングス	2,871,500	429.20	1,232,447,800
トレンドマイクロ	97,600	8,740.00	853,024,000
IDホールディングス	12,800	898.00	11,494,400
日本オラクル	32,300	8,620.00	278,426,000
アルファシステムズ	5,400	4,645.00	25,083,000
フューチャー	42,200	1,701.00	71,782,200
CAC Holdings	10,500	1,434.00	15,057,000
SBテクノロジー	8,700	2,488.00	21,645,600
トーセ	5,200	814.00	4,232,800
オービックビジネスコンサルタント	19,000	5,030.00	95,570,000
伊藤忠テクノソリューションズ	90,800	3,545.00	321,886,000
アイティフォー	24,400	788.00	19,227,200
東計電算	2,400	6,420.00	15,408,000
エクスネット	3,300	1,003.00	3,309,900
大塚商会	95,800	4,625.00	443,075,000
サイボウズ	23,500	1,262.00	29,657,000
電通国際情報サービス	20,600	4,635.00	95,481,000
ACCESS	22,800	792.00	18,057,600
デジタルガレージ	33,000	3,980.00	131,340,000
EMシステムズ	28,400	1,026.00	29,138,400
ウェザーニューズ	6,000	8,150.00	48,900,000
CIJ	15,700	800.00	12,560,000
ビジネスエンジニアリング	4,600	2,482.00	11,417,200
日本エンタープライズ	20,900	165.00	3,448,500
WOWOW	8,300	1,386.00	11,503,800
スカラ	17,000	745.00	12,665,000
インテリジェント ウェイブ	10,200	854.00	8,710,800
IMAGICA GROUP	14,400	830.00	11,952,000
ネットワンシステムズ	73,500	3,130.00	230,055,000
システムソフト	61,000	108.00	6,588,000
アルゴグラフィックス	15,600	3,780.00	58,968,000
マーベラス	31,700	683.00	21,651,100
エイベックス	34,500	1,608.00	55,476,000
BIPROGY	62,300	3,130.00	194,999,000
兼松エレクトロニクス	10,900	4,265.00	46,488,500
都築電気	9,100	1,387.00	12,621,700
TBSホールディングス	97,400	1,651.00	160,807,400
日本テレビホールディングス	166,400	1,215.00	202,176,000
朝日放送グループホールディングス	16,200	655.00	10,611,000
テレビ朝日ホールディングス	48,000	1,458.00	69,984,000

スカパーJ S A Tホールディングス	169,000	580.00	98,020,000
テレビ東京ホールディングス	12,400	1,993.00	24,713,200
日本BS放送	7,000	989.00	6,923,000
ビジョン	22,400	1,239.00	27,753,600
スマートバリュー	5,000	498.00	2,490,000
USEN-NEXT HOLDINGS	15,300	2,113.00	32,328,900
ワイヤレスゲート	9,000	286.00	2,574,000
コネクシオ	14,300	1,323.00	18,918,900
クロップス	3,900	940.00	3,666,000
日本電信電話	2,231,600	3,790.00	8,457,764,000
KDDI	1,451,500	4,240.00	6,154,360,000
ソフトバンク	3,015,700	1,535.50	4,630,607,350
光通信	23,000	17,520.00	402,960,000
エムティーアイ	15,900	509.00	8,093,100
GMOインターネット	62,900	2,623.00	164,986,700
ファイバーゲート	9,300	1,044.00	9,709,200
アйдママーケティングコミュニケーション	5,000	293.00	1,465,000
KADOKAWA	107,300	3,045.00	326,728,500
学研ホールディングス	28,400	974.00	27,661,600
ゼンリン	32,800	938.00	30,766,400
昭文社ホールディングス	8,700	325.00	2,827,500
インプレスホールディングス	17,500	201.00	3,517,500
アイネット	9,400	1,376.00	12,934,400
松竹	11,400	12,700.00	144,780,000
東宝	117,500	5,360.00	629,800,000
東映	5,600	18,890.00	105,784,000
エヌ・ティ・ティ・データ	530,200	2,057.00	1,090,621,400
ピー・シー・エー	11,800	1,130.00	13,334,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,800	1,477.00	10,043,600
DTS	37,200	3,560.00	132,432,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	92,700	6,260.00	580,302,000
シーイーシー	21,500	1,294.00	27,821,000
カブコン	187,800	3,850.00	723,030,000
アイ・エス・ビー	8,800	1,256.00	11,052,800
ジャステック	10,600	1,209.00	12,815,400
SCSK	137,900	2,322.00	320,203,800
NSW	7,600	2,301.00	17,487,600
アイネス	17,300	1,659.00	28,700,700
TKC	30,400	3,595.00	109,288,000
富士ソフト	19,100	8,150.00	155,665,000
NSD	62,500	2,502.00	156,375,000
コナミグループ	72,300	7,500.00	542,250,000

福井コンピュータホールディングス	9,200	3,625.00	33,350,000
J B C Cホールディングス	13,600	1,805.00	24,548,000
ミロク情報サービス	17,700	1,511.00	26,744,700
ソフトバンクグループ	1,193,900	5,739.00	6,851,792,100
高千穂交易	7,100	2,408.00	17,096,800
オルパヘルスケアホールディングス	3,300	1,529.00	5,045,700
伊藤忠食品	4,000	5,150.00	20,600,000
エレマテック	16,000	1,383.00	22,128,000
あらた	14,800	4,220.00	62,456,000
トーメンデバイス	3,000	5,400.00	16,200,000
東京エレクトロン デバイス	5,900	5,890.00	34,751,000
フィールズ	17,500	1,375.00	24,062,500
双日	205,000	2,314.00	474,370,000
アルフレッサ ホールディングス	207,300	1,687.00	349,715,100
横浜冷凍	48,600	938.00	45,586,800
ラサ商事	9,100	977.00	8,890,700
アルコニックス	25,400	1,389.00	35,280,600
神戸物産	137,900	3,960.00	546,084,000
ハイパー	3,800	437.00	1,660,600
あい ホールディングス	28,500	1,934.00	55,119,000
ディーブイエックス	6,800	958.00	6,514,400
ダイワボウホールディングス	85,000	1,931.00	164,135,000
マクニカホールディングス	47,700	2,860.00	136,422,000
ラクト・ジャパン	6,900	2,306.00	15,911,400
グリムス	8,900	1,723.00	15,334,700
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,900	669.00	21,341,100
八洲電機	14,500	1,046.00	15,167,000
メディアスホールディングス	11,400	814.00	9,279,600
レスターホールディングス	19,000	2,096.00	39,824,000
ジューテックホールディングス	3,900	1,101.00	4,293,900
大光	8,500	712.00	6,052,000
O C H Iホールディングス	4,500	1,232.00	5,544,000
T O K A Iホールディングス	96,800	894.00	86,539,200
黒谷	5,500	632.00	3,476,000
C o m i n i x	3,500	722.00	2,527,000
三洋貿易	18,300	1,020.00	18,666,000
ビューティガレージ	3,200	2,990.00	9,568,000
ウイン・パートナーズ	14,500	998.00	14,471,000
ミタチ産業	5,100	777.00	3,962,700
シップヘルスケアホールディングス	57,700	2,587.00	149,269,900
明治電機工業	6,000	1,074.00	6,444,000
デリカフーズホールディングス	7,800	515.00	4,017,000

スターティアホールディングス	4,600	910.00	4,186,000
コメダホールディングス	43,600	2,309.00	100,672,400
ピーバンドットコム	2,900	518.00	1,502,200
アセンテック	6,900	650.00	4,485,000
富士興産	5,000	1,188.00	5,940,000
協栄産業	2,000	1,413.00	2,826,000
フルサト・マルカホールディングス	17,700	3,315.00	58,675,500
ヤマエグループホールディングス	11,200	1,604.00	17,964,800
小野建	17,900	1,464.00	26,205,600
南陽	3,800	1,909.00	7,254,200
佐島電機	12,500	1,178.00	14,725,000
エコートレーディング	4,300	575.00	2,472,500
伯東	11,700	3,230.00	37,791,000
コンドーテック	15,000	1,027.00	15,405,000
中山福	10,700	309.00	3,306,300
ナガイレーベン	24,100	2,088.00	50,320,800
三菱食品	19,200	3,490.00	67,008,000
松田産業	14,600	2,417.00	35,288,200
第一興商	37,900	4,000.00	151,600,000
メディバルホールディングス	184,900	1,956.00	361,664,400
S P K	7,900	1,425.00	11,257,500
萩原電気ホールディングス	6,800	2,322.00	15,789,600
アズワン	28,700	6,420.00	184,254,000
スズデン	6,300	2,084.00	13,129,200
尾家産業	4,700	887.00	4,168,900
シモジマ	12,300	1,061.00	13,050,300
ドウシシャ	18,900	1,547.00	29,238,300
小津産業	4,400	1,832.00	8,060,800
高速	10,600	1,539.00	16,313,400
たけびし	6,800	1,523.00	10,356,400
リックス	4,100	1,920.00	7,872,000
丸文	16,000	793.00	12,688,000
ハピネット	15,200	1,643.00	24,973,600
橋本総業ホールディングス	3,500	2,086.00	7,301,000
日本ライフライン	59,200	1,032.00	61,094,400
タカショー	15,600	798.00	12,448,800
I D O M	60,700	852.00	51,716,400
進和	11,800	2,273.00	26,821,400
エスケイジャパン	4,900	541.00	2,650,900
ダイトロン	7,000	2,076.00	14,532,000
シークス	25,400	1,064.00	27,025,600
田中商事	6,200	570.00	3,534,000

オーハシテクニカ	9,900	1,422.00	14,077,800
白銅	6,400	2,664.00	17,049,600
ダイコー通産	2,400	1,109.00	2,661,600
伊藤忠商事	1,198,000	3,897.00	4,668,606,000
丸紅	1,731,100	1,403.50	2,429,598,850
高島	2,900	2,558.00	7,418,200
長瀬産業	91,400	2,020.00	184,628,000
蝶理	11,200	2,069.00	23,172,800
豊田通商	178,400	4,830.00	861,672,000
三共生興	25,700	491.00	12,618,700
兼松	69,200	1,523.00	105,391,600
ツカモトコーポレーション	3,300	1,038.00	3,425,400
三井物産	1,448,500	3,170.00	4,591,745,000
日本紙パルプ商事	9,500	4,380.00	41,610,000
カメイ	21,400	1,101.00	23,561,400
東都水産	1,000	4,865.00	4,865,000
OUGホールディングス	2,900	2,980.00	8,642,000
スターゼン	13,500	2,185.00	29,497,500
山善	72,100	960.00	69,216,000
椿本興業	3,300	3,750.00	12,375,000
住友商事	1,182,400	1,932.50	2,284,988,000
内田洋行	7,900	5,000.00	39,500,000
三菱商事	1,310,200	4,429.00	5,802,875,800
第一実業	7,700	3,710.00	28,567,000
キャノンマーケティングジャパン	41,300	3,235.00	133,605,500
西華産業	8,600	1,650.00	14,190,000
佐藤商事	13,800	1,149.00	15,856,200
菱洋エレクトロ	11,800	2,344.00	27,659,200
東京産業	16,300	769.00	12,534,700
ユアサ商事	16,100	3,550.00	57,155,000
神鋼商事	4,500	4,250.00	19,125,000
トルク	10,800	199.00	2,149,200
阪和興業	34,700	3,375.00	117,112,500
正栄食品工業	11,900	4,085.00	48,611,500
カナデン	16,300	1,072.00	17,473,600
菱電商事	15,800	1,660.00	26,228,000
岩谷産業	44,300	5,680.00	251,624,000
ナイス	6,100	1,665.00	10,156,500
ニチモウ	2,400	2,643.00	6,343,200
極東貿易	5,700	2,686.00	15,310,200
アステナホールディングス	30,900	451.00	13,935,900
三愛オブリ	44,800	1,135.00	50,848,000

稲畑産業	40,000	2,464.00	98,560,000
G S I クレオス	9,600	1,492.00	14,323,200
明和産業	18,500	803.00	14,855,500
クワザワホールディングス	7,200	432.00	3,110,400
ワキタ	36,100	1,171.00	42,273,100
東邦ホールディングス	54,300	1,881.00	102,138,300
サンゲツ	48,500	1,657.00	80,364,500
ミツウロコグループホールディングス	23,000	1,011.00	23,253,000
シナネンホールディングス	6,600	3,795.00	25,047,000
伊藤忠エネクス	44,200	1,110.00	49,062,000
サンリオ	56,100	3,545.00	198,874,500
サンワテクノス	10,100	1,457.00	14,715,700
リョーサン	20,500	2,278.00	46,699,000
新光商事	26,400	946.00	24,974,400
トーヨー	7,700	1,343.00	10,341,100
三信電気	8,200	1,705.00	13,981,000
東陽テクニカ	19,800	1,328.00	26,294,400
モスフードサービス	26,200	3,200.00	83,840,000
加賀電子	16,300	4,070.00	66,341,000
ソーダニッカ	16,000	604.00	9,664,000
立花エレテック	13,000	1,641.00	21,333,000
フォーバル	7,000	1,000.00	7,000,000
P A L T A C	28,000	4,235.00	118,580,000
三谷産業	31,300	313.00	9,796,900
西本W i s m e t t a cホールディングス	4,500	3,990.00	17,955,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,800	1,654.00	2,977,200
コア商事ホールディングス	12,500	715.00	8,937,500
国際紙パルプ商事	37,000	693.00	25,641,000
ヤマタネ	8,600	1,622.00	13,949,200
丸紅建材リース	1,800	1,907.00	3,432,600
日鉄物産	12,200	5,320.00	64,904,000
泉州電業	4,500	5,510.00	24,795,000
トラスコ中山	37,400	1,970.00	73,678,000
オートバックスセブン	62,100	1,431.00	88,865,100
モリト	13,200	718.00	9,477,600
加藤産業	21,600	3,475.00	75,060,000
北恵	4,500	783.00	3,523,500
イノテック	12,100	1,352.00	16,359,200
イエローハット	31,500	1,824.00	57,456,000
J Kホールディングス	14,100	1,034.00	14,579,400
日伝	13,600	1,937.00	26,343,200
北沢産業	10,700	201.00	2,150,700

杉本商事	9,400	2,058.00	19,345,200
因幡電機産業	49,800	2,818.00	140,336,400
東テク	6,000	3,590.00	21,540,000
ミスミグループ本社	250,900	3,505.00	879,404,500
アルテック	11,100	301.00	3,341,100
タキヒヨー	5,400	790.00	4,266,000
蔵王産業	3,900	1,810.00	7,059,000
スズケン	71,600	3,455.00	247,378,000
ジェコス	13,800	834.00	11,509,200
グローセル	21,700	410.00	8,897,000
ローソン	44,300	4,800.00	212,640,000
サンエー	13,700	4,230.00	57,951,000
カワチ薬品	15,700	2,169.00	34,053,300
エービーシー・マート	31,300	5,760.00	180,288,000
ハードオフコーポレーション	9,100	1,105.00	10,055,500
アスクル	43,200	1,814.00	78,364,800
ゲオホールディングス	24,300	1,601.00	38,904,300
アダストリア	21,700	1,993.00	43,248,100
くら寿司	21,000	3,320.00	69,720,000
キャンドウ	6,500	2,186.00	14,209,000
アイケイ	7,100	440.00	3,124,000
パルグループホールディングス	17,600	2,373.00	41,764,800
エディオン	92,000	1,214.00	111,688,000
サーラコーポレーション	37,900	773.00	29,296,700
ワッツ	10,100	742.00	7,494,200
ハローズ	9,200	3,115.00	28,658,000
フジオフードグループ本社	14,800	1,333.00	19,728,400
あみやき亭	4,900	2,912.00	14,268,800
大黒天物産	6,400	5,710.00	36,544,000
ハニーズホールディングス	16,100	1,247.00	20,076,700
ファーマライズホールディングス	4,800	686.00	3,292,800
アルペン	14,900	2,146.00	31,975,400
ハブ	7,100	551.00	3,912,100
クオールホールディングス	24,800	1,241.00	30,776,800
ジズホールディングス	10,700	4,260.00	45,582,000
ビックカメラ	118,800	1,156.00	137,332,800
D C Mホールディングス	119,000	1,052.00	125,188,000
Monotaro	252,800	2,663.00	673,206,400
東京一番フーズ	5,100	587.00	2,993,700
きちりホールディングス	5,300	361.00	1,913,300
アーランドサービスホールディングス	14,800	2,093.00	30,976,400
J.フロント リテイリング	221,900	1,074.00	238,320,600

ドトール・日レスホールディングス	31,800	1,629.00	51,802,200
マツキヨココカラ&カンパニー	117,100	5,430.00	635,853,000
ブロンコビリー	9,600	2,408.00	23,116,800
Z O Z O	137,500	3,160.00	434,500,000
トレジャー・ファクトリー	6,100	1,696.00	10,345,600
物語コーポレーション	10,000	6,820.00	68,200,000
三越伊勢丹ホールディングス	300,300	1,030.00	309,309,000
H a m e e	7,500	1,125.00	8,437,500
マーケットエンタープライズ	2,400	873.00	2,095,200
ウエルシアホールディングス	105,800	3,105.00	328,509,000
クリエイティブSDホールディングス	29,600	3,295.00	97,532,000
丸善C H Iホールディングス	24,300	373.00	9,063,900
ミサワ	4,600	606.00	2,787,600
ティーライフ	3,000	1,317.00	3,951,000
チムニー	6,100	1,203.00	7,338,300
シュッピン	16,700	1,236.00	20,641,200
オイシックス・ラ・大地	28,900	2,027.00	58,580,300
ネクステージ	40,700	3,130.00	127,391,000
ジョイフル本田	57,500	1,731.00	99,532,500
鳥貴族ホールディングス	6,700	2,202.00	14,753,400
ホットランド	13,900	1,314.00	18,264,600
すかいらーくホールディングス	243,900	1,527.00	372,435,300
S F Pホールディングス	9,700	1,818.00	17,634,600
綿半ホールディングス	14,000	1,437.00	20,118,000
ヨシックスホールディングス	4,100	2,393.00	9,811,300
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	58,400	1,103.00	64,415,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,300	2,014.00	16,716,200
B E E N O S	10,200	2,526.00	25,765,200
あさひ	16,800	1,325.00	22,260,000
日本調剤	12,400	1,373.00	17,025,200
コスモス薬品	20,200	15,080.00	304,616,000
トーエル	9,100	912.00	8,299,200
セブン&アイ・ホールディングス	670,100	5,745.00	3,849,724,500
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	134,100	964.00	129,272,400
ツルハホールディングス	43,700	7,910.00	345,667,000
サンマルクホールディングス	16,000	1,622.00	25,952,000
フェリシモ	4,800	1,072.00	5,145,600
トリドールホールディングス	49,900	2,933.00	146,356,700
T O K Y O B A S E	19,400	340.00	6,596,000
ウイルプラスホールディングス	4,100	1,039.00	4,259,900
J Mホールディングス	15,400	1,591.00	24,501,400

サツドラホールディングス	9,500	643.00	6,108,500
アレンザホールディングス	13,700	1,050.00	14,385,000
串カツ田中ホールディングス	4,900	1,925.00	9,432,500
パロックジャパンリミテッド	14,300	819.00	11,711,700
クスリのアオキホールディングス	17,900	6,310.00	112,949,000
力の源ホールディングス	10,600	660.00	6,996,000
FOOD & LIFE COMPANIES	102,500	2,444.00	250,510,000
メディカルシステムネットワーク	18,200	430.00	7,826,000
はるやまホールディングス	10,200	441.00	4,498,200
ノジマ	32,400	2,830.00	91,692,000
カップ・クリエイト	28,000	1,420.00	39,760,000
ライトオン	14,900	739.00	11,011,100
良品計画	230,200	1,314.00	302,482,800
パリティホールディングス	26,100	264.00	6,890,400
アドヴァングループ	17,400	832.00	14,476,800
アルビス	6,000	2,302.00	13,812,000
コナカ	21,600	349.00	7,538,400
ハウス オブ ローゼ	2,700	1,643.00	4,436,100
G-7ホールディングス	22,400	1,517.00	33,980,800
イオン北海道	26,500	1,137.00	30,130,500
コジマ	34,900	684.00	23,871,600
ヒマラヤ	6,600	1,005.00	6,633,000
コーナン商事	28,500	3,620.00	103,170,000
エコス	6,800	1,907.00	12,967,600
ワタミ	24,200	935.00	22,627,000
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	399,700	2,487.00	994,053,900
西松屋チェーン	39,700	1,665.00	66,100,500
ゼンショーホールディングス	97,700	3,580.00	349,766,000
幸楽苑ホールディングス	11,600	1,195.00	13,862,000
ハークスレイ	9,000	501.00	4,509,000
サイゼリヤ	29,800	2,611.00	77,807,800
V Tホールディングス	75,900	490.00	37,191,000
魚力	5,700	2,476.00	14,113,200
フジ・コーポレーション	10,900	1,248.00	13,603,200
ユナイテッドアローズ	21,100	1,818.00	38,359,800
ハイデイ日高	29,000	2,152.00	62,408,000
YU-WA Creation Holdings	13,500	203.00	2,740,500
コロワイド	82,100	1,858.00	152,541,800
ピーシーデポコーポレーション	24,400	297.00	7,246,800
壱番屋	14,200	4,710.00	66,882,000

P L A N T	5,100	672.00	3,427,200	
スギホールディングス	40,000	6,190.00	247,600,000	
薬王堂ホールディングス	10,100	2,402.00	24,260,200	
スクロール	31,200	794.00	24,772,800	
ヨンドシーホールディングス	17,100	1,840.00	31,464,000	
木曽路	27,100	2,179.00	59,050,900	
S R S ホールディングス	29,500	862.00	25,429,000	
千趣会	33,700	394.00	13,277,800	
リテールパートナーズ	26,700	1,194.00	31,879,800	
ケーヨー	37,100	970.00	35,987,000	
上新電機	19,600	1,961.00	38,435,600	
日本瓦斯	95,700	2,231.00	213,506,700	
ロイヤルホールディングス	34,000	2,205.00	74,970,000	
いなげや	20,000	1,266.00	25,320,000	
チヨダ	17,500	818.00	14,315,000	
ライフコーポレーション	15,700	2,731.00	42,876,700	
リンガーハット	23,000	2,285.00	52,555,000	
M r M a x H D	25,500	646.00	16,473,000	
A O K I ホールディングス	39,200	693.00	27,165,600	
オークワ	28,700	913.00	26,203,100	
コメリ	31,000	2,633.00	81,623,000	
青山商事	38,500	902.00	34,727,000	
しまむら	23,300	12,410.00	289,153,000	
はせがわ	11,700	360.00	4,212,000	
高島屋	134,500	1,462.00	196,639,000	
松屋	33,800	866.00	29,270,800	
エイチ・ツー・オー リテイリング	87,000	937.00	81,519,000	
近鉄百貨店	5,900	2,322.00	13,699,800	
丸井グループ	144,700	2,463.00	356,396,100	
アクシアル リテイリング	13,400	3,420.00	45,828,000	
イオン	659,200	2,829.50	1,865,206,400	
イズミ	31,700	3,025.00	95,892,500	
平和堂	29,900	2,021.00	60,427,900	
フジ	43,900	2,008.00	88,151,200	
ヤオコー	22,700	6,640.00	150,728,000	
ゼビオホールディングス	27,500	965.00	26,537,500	
ケーズホールディングス	170,400	1,309.00	223,053,600	
O l y m p i c グループ	9,400	603.00	5,668,200	
日産東京販売ホールディングス	30,800	268.00	8,254,400	
シルバーライフ	4,400	1,338.00	5,887,200	
Genky DrugStores	8,900	3,640.00	32,396,000	
ナルミヤ・インターナショナル	4,900	862.00	4,223,800	

ブックオフグループホールディングス	12,000	1,029.00	12,348,000
ギフトホールディングス	3,900	2,843.00	11,087,700
アインホールディングス	24,600	7,860.00	193,356,000
元気寿司	5,700	2,546.00	14,512,200
ヤマダホールディングス	707,700	479.00	338,988,300
アークランドサカモト	31,500	1,595.00	50,242,500
ニトリホールディングス	79,300	14,050.00	1,114,165,000
グルメ杵屋	16,200	1,035.00	16,767,000
愛眼	14,600	177.00	2,584,200
ケーユーホールディングス	10,700	1,279.00	13,685,300
吉野家ホールディングス	69,900	2,491.00	174,120,900
松屋フーズホールディングス	9,700	3,900.00	37,830,000
サガミホールディングス	28,900	1,201.00	34,708,900
関西フードマーケット	16,400	1,254.00	20,565,600
王将フードサービス	13,300	6,700.00	89,110,000
プレナス	22,600	1,971.00	44,544,600
ミニストップ	14,900	1,462.00	21,783,800
アークス	35,600	2,119.00	75,436,400
パローホールディングス	41,000	1,866.00	76,506,000
ベルク	8,900	5,570.00	49,573,000
大庄	11,000	1,178.00	12,958,000
ファーストリテイリング	26,700	85,210.00	2,275,107,000
サンドラッグ	75,300	3,485.00	262,420,500
サクスパー ホールディングス	19,400	604.00	11,717,600
ヤマザワ	4,400	1,398.00	6,151,200
やまや	4,200	2,619.00	10,999,800
ベルーナ	43,400	729.00	31,638,600
島根銀行	6,400	477.00	3,052,800
じもとホールディングス	13,200	565.00	7,458,000
めぶきフィナンシャルグループ	823,200	265.00	218,148,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	23,200	2,254.00	52,292,800
九州フィナンシャルグループ	350,300	395.00	138,368,500
ゆうちょ銀行	472,400	1,022.00	482,792,800
富山第一銀行	44,500	422.00	18,779,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	990,500	447.00	442,753,500
西日本フィナンシャルホールディングス	105,000	742.00	77,910,000
三十三フィナンシャルグループ	16,100	1,475.00	23,747,500
第四北越フィナンシャルグループ	28,200	2,606.00	73,489,200
ひろぎんホールディングス	255,800	621.00	158,851,800
おきなわフィナンシャルグループ	16,900	2,246.00	37,957,400
十六フィナンシャルグループ	23,300	2,476.00	57,690,800
北國フィナンシャルホールディングス	16,500	4,695.00	77,467,500

プロクレアホールディングス	20,300	2,199.00	44,639,700
新生銀行	130,500	1,968.00	256,824,000
あおぞら銀行	111,800	2,695.00	301,301,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,713,200	732.40	8,578,747,680
りそなホールディングス	2,117,400	514.20	1,088,767,080
三井住友トラスト・ホールディングス	331,000	4,311.00	1,426,941,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,298,600	4,191.00	5,442,432,600
千葉銀行	565,100	753.00	425,520,300
群馬銀行	321,900	378.00	121,678,200
武蔵野銀行	25,600	1,735.00	44,416,000
千葉興業銀行	43,100	265.00	11,421,500
筑波銀行	78,000	193.00	15,054,000
七十七銀行	53,100	1,734.00	92,075,400
秋田銀行	12,000	1,696.00	20,352,000
山形銀行	18,400	944.00	17,369,600
岩手銀行	12,200	1,907.00	23,265,400
東邦銀行	143,100	209.00	29,907,900
東北銀行	9,000	971.00	8,739,000
ふくおかフィナンシャルグループ	144,500	2,458.00	355,181,000
静岡銀行	412,400	818.00	337,343,200
スルガ銀行	175,500	383.00	67,216,500
八十二銀行	371,200	490.00	181,888,000
山梨中央銀行	20,100	1,173.00	23,577,300
大垣共立銀行	34,300	1,750.00	60,025,000
福井銀行	16,000	1,405.00	22,480,000
清水銀行	7,100	1,495.00	10,614,500
富山銀行	3,100	1,771.00	5,490,100
滋賀銀行	32,600	2,653.00	86,487,800
南都銀行	27,000	1,985.00	53,595,000
百五銀行	168,100	326.00	54,800,600
京都銀行	62,100	5,540.00	344,034,000
紀陽銀行	59,400	1,517.00	90,109,800
ほくほくフィナンシャルグループ	113,600	844.00	95,878,400
山陰合同銀行	111,200	685.00	76,172,000
中国銀行	140,800	962.00	135,449,600
鳥取銀行	6,400	1,123.00	7,187,200
伊予銀行	224,300	673.00	150,953,900
百十四銀行	18,400	1,710.00	31,464,000
四国銀行	26,300	856.00	22,512,800
阿波銀行	26,600	1,990.00	52,934,000
大分銀行	10,700	1,920.00	20,544,000
宮崎銀行	10,800	2,190.00	23,652,000

佐賀銀行	10,500	1,530.00	16,065,000
琉球銀行	43,400	784.00	34,025,600
セブン銀行	594,300	265.00	157,489,500
みずほフィナンシャルグループ	2,399,300	1,576.00	3,781,296,800
高知銀行	6,300	685.00	4,315,500
山口フィナンシャルグループ	199,800	774.00	154,645,200
長野銀行	6,100	1,325.00	8,082,500
名古屋銀行	12,200	3,110.00	37,942,000
北洋銀行	251,400	234.00	58,827,600
愛知銀行	6,200	5,660.00	35,092,000
中京銀行	6,200	1,823.00	11,302,600
大光銀行	5,900	1,376.00	8,118,400
愛媛銀行	26,100	862.00	22,498,200
トマト銀行	6,100	1,047.00	6,386,700
京葉銀行	83,500	478.00	39,913,000
栃木銀行	89,800	303.00	27,209,400
北日本銀行	5,800	1,689.00	9,796,200
東和銀行	32,800	537.00	17,613,600
福島銀行	21,200	227.00	4,812,400
大東銀行	8,800	647.00	5,693,600
トモニホールディングス	144,400	322.00	46,496,800
フィデアホールディングス	18,300	1,337.00	24,467,100
池田泉州ホールディングス	212,400	215.00	45,666,000
F P G	67,600	1,233.00	83,350,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,700	1,381.00	18,919,700
マーキュリアホールディングス	11,200	620.00	6,944,000
S B Iホールディングス	247,300	2,734.00	676,118,200
ジャフコ グループ	69,400	2,264.00	157,121,600
大和証券グループ本社	1,285,600	609.00	782,930,400
野村ホールディングス	3,055,800	507.10	1,549,596,180
岡三証券グループ	145,000	344.00	49,880,000
丸三証券	60,000	486.00	29,160,000
東洋証券	61,600	256.00	15,769,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	197,700	376.00	74,335,200
光世証券	4,800	450.00	2,160,000
水戸証券	50,000	271.00	13,550,000
いちよし証券	33,500	635.00	21,272,500
松井証券	98,300	803.00	78,934,900
マネックスグループ	169,000	493.00	83,317,000
極東証券	23,100	707.00	16,331,700
岩井コスモホールディングス	19,100	1,269.00	24,237,900
アイザワ証券グループ	27,300	651.00	17,772,300

マネーパートナーズグループ	22,300	248.00	5,530,400
スパークス・グループ	93,300	311.00	29,016,300
かんぽ生命保険	201,400	2,160.00	435,024,000
S O M P Oホールディングス	284,700	5,945.00	1,692,541,500
アニコム ホールディングス	61,500	682.00	41,943,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	411,400	4,168.00	1,714,715,200
第一生命ホールディングス	974,500	2,431.00	2,369,009,500
東京海上ホールディングス	556,800	7,716.00	4,296,268,800
T & Dホールディングス	445,200	1,490.00	663,348,000
アドバンスクリエイト	9,600	1,086.00	10,425,600
全国保証	47,900	4,510.00	216,029,000
あんしん保証	10,000	264.00	2,640,000
イントラスト	9,400	643.00	6,044,200
日本モーゲージサービス	11,700	947.00	11,079,900
C a s a	7,700	864.00	6,652,800
アルヒ	30,100	1,073.00	32,297,300
プレミアグループ	10,300	5,210.00	53,663,000
ネットプロテクションズホールディングス	61,700	562.00	34,675,400
クレディセゾン	117,200	1,752.00	205,334,400
芙蓉総合リース	17,300	8,180.00	141,514,000
みずほリース	24,900	3,415.00	85,033,500
東京センチュリー	31,100	5,080.00	157,988,000
日本証券金融	79,400	851.00	67,569,400
アイフル	337,500	386.00	130,275,000
リコーリース	17,900	3,725.00	66,677,500
イオンフィナンシャルサービス	109,300	1,436.00	156,954,800
アコム	396,700	340.00	134,878,000
ジャックス	20,100	3,800.00	76,380,000
オリエントコーポレーション	546,100	124.00	67,716,400
オリックス	1,189,200	2,273.50	2,703,646,200
三菱H C キャピタル	647,800	666.00	431,434,800
九州リースサービス	9,500	599.00	5,690,500
日本取引所グループ	466,400	2,161.50	1,008,123,600
イー・ギャランティ	30,000	2,423.00	72,690,000
アサックス	11,300	602.00	6,802,600
N E C キャピタルソリューション	8,400	2,153.00	18,085,200
いちご	229,400	314.00	72,031,600
日本駐車場開発	209,100	162.00	33,874,200
スター・マイカ・ホールディングス	9,700	1,593.00	15,452,100
S R E ホールディングス	5,800	2,953.00	17,127,400
A Dワークスグループ	44,600	156.00	6,957,600
ヒューリック	389,000	1,066.00	414,674,000

三栄建築設計	9,200	1,699.00	15,630,800
野村不動産ホールディングス	104,200	3,395.00	353,759,000
三重交通グループホールディングス	44,500	490.00	21,805,000
サムティ	27,300	2,126.00	58,039,800
ディア・ライフ	27,800	653.00	18,153,400
地主	13,600	2,030.00	27,608,000
プレサンスコーポレーション	23,000	1,558.00	35,834,000
ハウスコム	5,500	946.00	5,203,000
JPMC	10,200	1,008.00	10,281,600
サンセイランディック	7,600	826.00	6,277,600
フージャースホールディングス	25,600	800.00	20,480,000
オープンハウスグループ	64,000	5,610.00	359,040,000
東急不動産ホールディングス	547,000	750.00	410,250,000
飯田グループホールディングス	164,400	2,240.00	368,256,000
イーランド	4,100	1,527.00	6,260,700
ムゲンエステート	16,200	483.00	7,824,600
And Doホールディングス	9,900	881.00	8,721,900
シーアールイー	8,700	1,715.00	14,920,500
ケイアイスター不動産	9,400	5,060.00	47,564,000
グッドコムアセット	9,200	1,324.00	12,180,800
ジェイ・エス・ビー	4,700	3,425.00	16,097,500
ロードスターキャピタル	8,100	1,932.00	15,649,200
テンポイノベーション	7,700	913.00	7,030,100
フェイスネットワーク	3,900	1,400.00	5,460,000
パーク24	130,400	1,995.00	260,148,000
パラカ	6,800	2,004.00	13,627,200
三井不動産	781,600	2,865.00	2,239,284,000
三菱地所	1,140,600	1,899.00	2,165,999,400
平和不動産	32,300	3,840.00	124,032,000
東京建物	159,100	2,125.00	338,087,500
京阪神ビルディング	27,600	1,281.00	35,355,600
住友不動産	360,500	3,473.00	1,252,016,500
テーオーシー	32,400	780.00	25,272,000
東京楽天地	3,300	4,055.00	13,381,500
スターツコーポレーション	27,900	2,715.00	75,748,500
フジ住宅	26,100	659.00	17,199,900
空港施設	23,400	555.00	12,987,000
明和地所	12,400	615.00	7,626,000
ゴールドクレスト	16,900	1,798.00	30,386,200
エスリード	8,900	1,736.00	15,450,400
日神グループホールディングス	36,800	432.00	15,897,600
日本エスコン	37,300	805.00	30,026,500

タカラレーベン	83,800	377.00	31,592,600
A V A N T I A	11,700	829.00	9,699,300
イオンモール	101,600	1,711.00	173,837,600
毎日コムネット	9,800	620.00	6,076,000
ファースト住建	9,100	1,148.00	10,446,800
カチタス	50,200	3,295.00	165,409,000
トーセイ	29,100	1,327.00	38,615,700
穴吹興産	5,300	2,100.00	11,130,000
サンフロンティア不動産	29,400	1,198.00	35,221,200
F Jネクストホールディングス	21,400	1,058.00	22,641,200
インテリックス	4,500	561.00	2,524,500
ランドビジネス	6,700	232.00	1,554,400
サンネクスタグループ	8,000	979.00	7,832,000
グランディハウス	16,900	551.00	9,311,900
日本空港ビルデング	64,900	5,390.00	349,811,000
明豊ファシリティワークス	9,400	676.00	6,354,400
日本工営	12,400	3,640.00	45,136,000
L I F U L L	61,300	174.00	10,666,200
ミクシィ	44,500	2,421.00	107,734,500
ジェイエシーリクルートメント	15,800	1,995.00	31,521,000
日本M & Aセンターホールディングス	318,200	1,815.00	577,533,000
メンバーズ	5,200	2,605.00	13,546,000
中広	4,000	402.00	1,608,000
UTグループ	28,100	2,774.00	77,949,400
アイティメディア	9,400	1,709.00	16,064,600
E・Jホールディングス	11,400	1,350.00	15,390,000
夢真ビーネックスグループ	63,500	1,722.00	109,347,000
コシダカホールディングス	52,300	811.00	42,415,300
アルトナー	5,100	912.00	4,651,200
パソナグループ	21,200	2,131.00	45,177,200
C D S	5,000	1,794.00	8,970,000
リンクアンドモチベーション	49,900	623.00	31,087,700
エス・エム・エス	66,000	3,360.00	221,760,000
サニーサイドアップグループ	7,200	628.00	4,521,600
パーソルホールディングス	194,000	2,870.00	556,780,000
リニカル	11,300	730.00	8,249,000
クックパッド	49,000	219.00	10,731,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	10,000	603.00	6,030,000
学情	8,200	1,147.00	9,405,400
スタジオアリス	8,800	2,336.00	20,556,800
シミックホールディングス	9,800	1,638.00	16,052,400
エプロ	4,600	690.00	3,174,000

N J S	4,000	2,035.00	8,140,000
総合警備保障	70,800	3,730.00	264,084,000
カカクコム	142,400	2,500.00	356,000,000
アイロムグループ	7,100	2,521.00	17,899,100
セントケア・ホールディング	13,000	899.00	11,687,000
サイネックス	3,900	595.00	2,320,500
ルネサンス	13,900	963.00	13,385,700
ディップ	34,200	3,660.00	125,172,000
デジタルホールディングス	13,800	1,320.00	18,216,000
新日本科学	23,800	2,347.00	55,858,600
キャリアデザインセンター	4,200	1,566.00	6,577,200
ベネフィット・ワン	70,400	2,174.00	153,049,600
エムスリー	342,200	4,843.00	1,657,274,600
ツカダ・グローバルホールディング	12,300	335.00	4,120,500
アウトソーシング	103,500	1,190.00	123,165,000
ウェルネット	17,900	475.00	8,502,500
ワールドホールディングス	7,900	2,730.00	21,567,000
ディー・エヌ・エー	74,000	1,941.00	143,634,000
博報堂D Yホールディングス	245,700	1,321.00	324,569,700
ぐるなび	29,100	453.00	13,182,300
タカミヤ	24,300	437.00	10,619,100
ジャパンベストレスキューシステム	10,900	719.00	7,837,100
ファンコミュニケーションズ	34,800	412.00	14,337,600
ライク	6,600	2,274.00	15,008,400
ビジネス・ブレークスルー	8,000	416.00	3,328,000
エスプール	50,100	1,079.00	54,057,900
W D Bホールディングス	9,000	2,510.00	22,590,000
ティア	12,100	441.00	5,336,100
C D G	2,300	1,275.00	2,932,500
アドウェイズ	24,300	765.00	18,589,500
バリューコマース	13,200	2,619.00	34,570,800
インフォマート	180,600	439.00	79,283,400
J Pホールディングス	51,200	261.00	13,363,200
エコナックホールディングス	37,300	88.00	3,282,400
C Lホールディングス	5,200	870.00	4,524,000
プレステージ・インターナショナル	73,200	700.00	51,240,000
アミューズ	10,700	1,975.00	21,132,500
ドリームインキュベータ	6,100	2,008.00	12,248,800
クイック	12,300	1,730.00	21,279,000
T A C	12,200	213.00	2,598,600
電通グループ	181,800	4,680.00	850,824,000
イオンファンタジー	7,600	3,250.00	24,700,000

シーティーエス	22,300	768.00	17,126,400
ネクシィーズグループ	6,600	580.00	3,828,000
H.U.グループホールディングス	50,800	3,155.00	160,274,000
アルプス技研	15,300	1,911.00	29,238,300
ダイオーズ	4,100	1,290.00	5,289,000
日本空調サービス	20,800	767.00	15,953,600
オリエンタルランド	206,200	20,680.00	4,264,216,000
ダスキン	41,900	2,932.00	122,850,800
明光ネットワークジャパン	23,400	617.00	14,437,800
ファルコホールディングス	8,700	1,883.00	16,382,100
ラウンドワン	54,300	1,974.00	107,188,200
リゾートトラスト	82,200	2,197.00	180,593,400
ビー・エム・エル	24,800	3,750.00	93,000,000
りらいあコミュニケーションズ	28,900	1,035.00	29,911,500
リソー教育	89,800	315.00	28,287,000
早稲田アカデミー	11,100	1,090.00	12,099,000
ユー・エス・エス	217,200	2,480.00	538,656,000
東京個別指導学院	17,700	582.00	10,301,400
サイバーエージェント	414,400	1,419.00	588,033,600
楽天グループ	800,500	704.00	563,552,000
クリーク・アンド・リバー社	10,300	2,329.00	23,988,700
モーニングスター	34,600	486.00	16,815,600
テー・オー・ダブリュー	38,200	308.00	11,765,600
山田コンサルティンググループ	10,300	1,312.00	13,513,600
セントラルスポーツ	7,400	2,534.00	18,751,600
フルキャストホールディングス	16,700	2,482.00	41,449,400
エン・ジャパン	34,600	2,371.00	82,036,600
リソルホールディングス	2,200	4,640.00	10,208,000
テクノプロ・ホールディングス	116,200	3,330.00	386,946,000
アトラグループ	4,300	189.00	812,700
インターワークス	6,500	366.00	2,379,000
アイ・アールジャパンホールディングス	9,100	2,347.00	21,357,700
Keeper 技研	12,600	4,225.00	53,235,000
ファーストロジック	3,500	814.00	2,849,000
三機サービス	3,700	995.00	3,681,500
Gunosy	11,100	787.00	8,735,700
デザインワン・ジャパン	7,700	180.00	1,386,000
イー・ガーディアン	6,700	2,987.00	20,012,900
リブセンス	10,000	328.00	3,280,000
ジャパンマテリアル	59,800	1,963.00	117,387,400
ベクトル	27,500	1,208.00	33,220,000
ウチヤマホールディングス	10,700	301.00	3,220,700

チャーム・ケア・コーポレーション	14,700	1,179.00	17,331,300
キャリアリンク	7,300	2,243.00	16,373,900
I B J	11,000	854.00	9,394,000
アサンテ	8,800	1,634.00	14,379,200
バリューHR	15,400	1,487.00	22,899,800
M & Aキャピタルパートナーズ	16,100	3,510.00	56,511,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,800	1,293.00	10,085,400
E R Iホールディングス	5,800	1,035.00	6,003,000
アビスト	3,100	3,025.00	9,377,500
シグマクシス・ホールディングス	23,600	1,243.00	29,334,800
ウィルグループ	14,700	1,382.00	20,315,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	22,400	159.00	3,561,600
メドピア	13,800	1,744.00	24,067,200
レアジョブ	4,200	737.00	3,095,400
リクルートホールディングス	1,388,900	4,837.00	6,718,109,300
エラン	23,200	1,097.00	25,450,400
土木管理総合試験所	9,200	322.00	2,962,400
ネットマーケティング	9,900	897.00	8,880,300
日本郵政	2,118,500	966.60	2,047,742,100
ベルシステム24ホールディングス	28,100	1,454.00	40,857,400
鎌倉新書	22,600	648.00	14,644,800
S M N	5,000	562.00	2,810,000
グローバルキッズCOMPANY	3,500	703.00	2,460,500
エアトリ	11,300	2,649.00	29,933,700
アトラエ	13,800	1,634.00	22,549,200
ストライク	8,600	4,065.00	34,959,000
ソラスト	48,100	832.00	40,019,200
セラク	6,400	1,117.00	7,148,800
インソース	21,600	2,772.00	59,875,200
ベイカレント・コンサルティング	13,700	42,900.00	587,730,000
Orchestra Holdings	3,800	2,663.00	10,119,400
アイモバイル	9,900	1,361.00	13,473,900
キャリアインデックス	7,300	455.00	3,321,500
MS - Japan	8,300	800.00	6,640,000
船場	3,800	689.00	2,618,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	61,700	1,870.00	115,379,000
フルテック	3,000	1,243.00	3,729,000
GameWith	6,600	400.00	2,640,000
MS & Consulting	3,400	639.00	2,172,600
ウェルビー	13,200	732.00	9,662,400
エル・ティー・エス	2,300	3,290.00	7,567,000
ミダックホールディングス	8,900	3,070.00	27,323,000

日総工産	15,700	575.00	9,027,500
キュービーネットホールディングス	9,200	1,420.00	13,064,000
R P Aホールディングス	28,500	317.00	9,034,500
スプリックス	7,000	1,079.00	7,553,000
マネジメントソリューションズ	9,600	2,965.00	28,464,000
プロレド・パートナーズ	4,900	521.00	2,552,900
テノ・ホールディングス	2,900	584.00	1,693,600
フロンティア・マネジメント	6,000	1,292.00	7,752,000
ピアラ	3,600	741.00	2,667,600
コプロ・ホールディングス	4,200	934.00	3,922,800
ギークス	3,700	915.00	3,385,500
カーブスホールディングス	53,700	789.00	42,369,300
フォーラムエンジニアリング	12,200	987.00	12,041,400
F a s t F i t n e s s J a p a n	3,800	1,589.00	6,038,200
ダイレクトマーケティングミックス	19,900	1,750.00	34,825,000
ポピンズ	2,800	1,941.00	5,434,800
L I T A L I C O	15,800	2,886.00	45,598,800
アドバンテッジリスクマネジメント	10,500	502.00	5,271,000
リログループ	106,200	2,191.00	232,684,200
東祥	14,800	1,110.00	16,428,000
ビーウィズ	5,400	1,392.00	7,516,800
T R Eホールディングス	36,700	1,673.00	61,399,100
人・夢・技術グループ	7,900	2,607.00	20,595,300
エイチ・アイ・エス	45,500	2,102.00	95,641,000
ラックランド	5,500	2,956.00	16,258,000
共立メンテナンス	34,700	5,210.00	180,787,000
イチネンホールディングス	20,200	1,298.00	26,219,600
建設技術研究所	9,100	2,597.00	23,632,700
スペース	13,000	854.00	11,102,000
燦ホールディングス	8,600	1,815.00	15,609,000
スバル興業	1,200	8,900.00	10,680,000
東京テアトル	7,100	1,219.00	8,654,900
タナベ経営	8,000	651.00	5,208,000
ナガワ	5,500	8,330.00	45,815,000
東京都競馬	14,600	4,215.00	61,539,000
カナモト	31,900	2,143.00	68,361,700
西尾レントオール	16,200	2,908.00	47,109,600
トランス・コスモス	24,700	3,800.00	93,860,000
乃村工藝社	83,500	960.00	80,160,000
藤田観光	7,700	2,566.00	19,758,200
K N T - C Tホールディングス	12,100	1,616.00	19,553,600
日本管財	20,900	2,715.00	56,743,500

トーカイ	15,500	1,860.00	28,830,000	
セコム	191,100	9,205.00	1,759,075,500	
セントラル警備保障	9,500	2,576.00	24,472,000	
丹青社	37,100	806.00	29,902,600	
メイテック	69,200	2,522.00	174,522,400	
応用地質	17,000	1,815.00	30,855,000	
船井総研ホールディングス	36,500	2,396.00	87,454,000	
進学会ホールディングス	7,400	327.00	2,419,800	
オオバ	12,600	730.00	9,198,000	
いであ	4,500	1,744.00	7,848,000	
学究社	6,400	1,605.00	10,272,000	
ベネッセホールディングス	64,800	2,164.00	140,227,200	
イオンディライト	22,500	2,943.00	66,217,500	
ナック	9,600	946.00	9,081,600	
ダイセキ	35,400	4,190.00	148,326,000	
ステップ	7,300	1,851.00	13,512,300	
合 計	205,488,400		517,126,614,130	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 8月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	423,645,524
国債証券	526,177,156,100
地方債証券	33,403,054,997
特殊債券	37,068,639,056
社債券	28,925,988,500
未収入金	501,089,000
未収利息	1,387,596,794

	2022年 8月22日現在
項目	金額（円）
前払費用	28,309,572
流動資産合計	627,915,479,543
資産合計	627,915,479,543
負債の部	
流動負債	
未払金	499,902,000
未払解約金	156,142,790
未払利息	178
流動負債合計	656,044,968
負債合計	656,044,968
純資産の部	
元本等	
元本	455,042,574,024
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	172,216,860,551
元本等合計	627,259,434,575
純資産合計	627,259,434,575
負債純資産合計	627,915,479,543

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 8月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 8月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	455,042,574,024口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。

	2022年 8月22日現在	
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	有価証券	100,305,000円
	1口当たり純資産額	1.3785円
	(1万口当たり純資産額)	(13,785円)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2022年 8月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2022年 8月22日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	463,227,658,646円
期中追加設定元本額	47,951,797,657円
期中一部解約元本額	56,136,882,279円
期末元本額	455,042,574,024円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,125,182,695円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,876,493円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,826,475,236円
世界経済インデックスファンド	3,965,929,174円
D C マイセレクション 2 5	25,890,172,337円
D C マイセレクション 5 0	29,666,429,968円
D C マイセレクション 7 5	8,678,899,984円
D C 日本債券インデックス・オープン	439,521,528円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,188,129,251円
D C 日本債券インデックス・オープン P	66,528,680,343円
D C マイセレクション S 2 5	13,169,233,339円
D C マイセレクション S 5 0	14,680,251,036円
D C マイセレクション S 7 5	3,347,368,910円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	791,418,747円

区分	2022年 8月22日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,231,467,086円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	831,688,596円
DC世界経済インデックスファンド	3,461,590,443円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	1,414,396円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	31,497,651円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	9,937,325円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	972,063円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	85,224,477円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	123,867,935円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	34,194,591円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	27,614,470円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,789,375,634円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	750,097,321円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,131,931,189円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	76,678,284円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	54,711,961円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	977,484,982円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,111,373,527円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,414,733,335円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	138,892,386円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,571,025,390円
日本債券ファンド・シリーズ1	16,482,151,547円
分散投資コア戦略ファンドA	20,452,828,218円
分散投資コア戦略ファンドS	25,571,521,445円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	168,783,281円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,421,002,445円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	72,704,127円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	36,582,611円
SMT インデックスバランス・オープン	61,778,221円
SMT 世界経済インデックス・オープン	39,392,302円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	77,586,892円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	122,687,874円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,339,802円
グローバル経済コア	234,660,673円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	31,854,165円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	18,883,175円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	31,483,769円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	16,578,045円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	4,094,380円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	3,395,483円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	7,715,879円
10資産分散投資ファンド	89,612円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	82,592,993,935円

区分	2022年 8月22日現在
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	88,616,291円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,453,877円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	307,826,652円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 8月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,943,799,250
地方債証券	151,299,583
特殊債券	139,322,897
社債券	203,845,880
合計	3,438,267,610

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第428回利付国債（2年）	230,000,000	230,317,400	
	第429回利付国債（2年）	950,000,000	951,415,500	
	第430回利付国債（2年）	990,000,000	991,534,500	
	第432回利付国債（2年）	1,550,000,000	1,552,526,500	
	第433回利付国債（2年）	1,910,000,000	1,913,170,600	
	第434回利付国債（2年）	1,915,000,000	1,918,198,050	
	第435回利付国債（2年）	3,120,000,000	3,125,491,200	
	第436回利付国債（2年）	720,000,000	721,274,400	
	第438回利付国債（2年）	290,000,000	290,510,400	

第137回利付国債(5年)	6,610,000,000	6,626,326,700	
第138回利付国債(5年)	6,890,000,000	6,909,154,200	
第139回利付国債(5年)	5,590,000,000	5,607,608,500	
第140回利付国債(5年)	4,660,000,000	4,676,170,200	
第141回利付国債(5年)	7,750,000,000	7,779,760,000	
第142回利付国債(5年)	4,370,000,000	4,388,834,700	
第143回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,822,272,000	
第144回利付国債(5年)	5,830,000,000	5,859,674,700	
第145回利付国債(5年)	5,670,000,000	5,700,561,300	
第146回利付国債(5年)	4,120,000,000	4,143,319,200	
第147回利付国債(5年)	4,170,000,000	4,180,425,000	
第148回利付国債(5年)	6,770,000,000	6,785,503,300	
第149回利付国債(5年)	4,920,000,000	4,930,036,800	
第150回利付国債(5年)	7,800,000,000	7,811,778,000	
第151回利付国債(5年)	4,000,000,000	4,003,640,000	
第152回利付国債(5年)	210,000,000	211,056,300	
第153回利付国債(5年)	410,000,000	409,897,500	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	523,096,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,423,641,800	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	696,410,000	
第4回利付国債(40年)	950,000,000	1,200,667,000	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,302,318,400	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,500,912,000	
第7回利付国債(40年)	1,240,000,000	1,417,667,200	
第8回利付国債(40年)	1,230,000,000	1,310,626,500	
第9回利付国債(40年)	2,050,000,000	1,618,782,500	
第10回利付国債(40年)	2,100,000,000	1,943,676,000	
第11回利付国債(40年)	1,635,000,000	1,462,834,500	
第12回利付国債(40年)	1,290,000,000	1,036,760,100	
第13回利付国債(40年)	2,120,000,000	1,696,148,400	
第14回利付国債(40年)	2,130,000,000	1,825,111,800	
第15回利付国債(40年)	610,000,000	570,374,400	
第330回利付国債(10年)	3,910,000,000	3,949,178,200	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	907,083,000	
第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,845,216,000	
第333回利付国債(10年)	3,320,000,000	3,356,586,400	
第334回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,313,718,600	
第335回利付国債(10年)	2,310,000,000	2,338,112,700	
第336回利付国債(10年)	1,210,000,000	1,226,492,300	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,825,116,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,616,407,200	
第339回利付国債(10年)	4,670,000,000	4,733,418,600	

第340回利付国債(10年)	4,830,000,000	4,900,711,200	
第341回利付国債(10年)	5,340,000,000	5,405,842,200	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,788,084,000	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,685,859,800	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,934,928,000	
第345回利付国債(10年)	3,780,000,000	3,801,281,400	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,780,245,000	
第347回利付国債(10年)	3,850,000,000	3,867,633,000	
第348回利付国債(10年)	4,740,000,000	4,759,197,000	
第349回利付国債(10年)	5,000,000,000	5,017,250,000	
第350回利付国債(10年)	6,390,000,000	6,409,489,500	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,940,000,000	4,952,893,400	
第352回利付国債(10年)	4,510,000,000	4,519,516,100	
第353回利付国債(10年)	5,415,000,000	5,425,180,200	
第354回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,796,227,000	
第355回利付国債(10年)	3,820,000,000	3,821,260,600	
第356回利付国債(10年)	3,380,000,000	3,375,234,200	
第357回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,759,944,900	
第358回利付国債(10年)	3,560,000,000	3,544,015,600	
第359回利付国債(10年)	3,360,000,000	3,343,099,200	
第360回利付国債(10年)	4,890,000,000	4,860,757,800	
第361回利付国債(10年)	4,180,000,000	4,152,537,400	
第362回利付国債(10年)	3,790,000,000	3,762,787,800	
第363回利付国債(10年)	5,070,000,000	5,030,352,600	
第364回利付国債(10年)	3,710,000,000	3,683,473,500	
第365回利付国債(10年)	6,940,000,000	6,885,868,000	
第366回利付国債(10年)	5,970,000,000	6,000,984,300	
第367回利付国債(10年)	1,120,000,000	1,117,838,400	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	130,777,900	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	186,753,600	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	139,738,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	134,468,400	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	58,715,500	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	421,029,000	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	216,214,200	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	404,817,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	267,916,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	173,739,200	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	298,945,400	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	227,027,200	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	474,224,000	
第14回利付国債(30年)	800,000,000	986,240,000	

第15回利付国債(30年)	340,000,000	423,963,000
第16回利付国債(30年)	200,000,000	249,968,000
第17回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,426,874,000
第18回利付国債(30年)	345,000,000	424,736,400
第19回利付国債(30年)	530,000,000	653,240,900
第20回利付国債(30年)	480,000,000	604,881,600
第21回利付国債(30年)	500,000,000	618,235,000
第22回利付国債(30年)	540,000,000	683,348,400
第23回利付国債(30年)	430,000,000	545,080,900
第24回利付国債(30年)	780,000,000	989,710,800
第25回利付国債(30年)	600,000,000	746,370,000
第26回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,752,289,600
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,454,912,000
第28回利付国債(30年)	2,090,000,000	2,678,418,600
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,120,065,000
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,223,562,500
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,366,266,000
第32回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,713,899,200
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,204,948,200
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,235,690,450
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	2,789,095,000
第36回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,588,823,300
第37回利付国債(30年)	2,255,000,000	2,698,084,950
第38回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,662,009,300
第39回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,772,181,600
第40回利付国債(30年)	1,380,000,000	1,625,957,400
第41回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,332,482,000
第42回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,343,419,200
第43回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,504,802,000
第44回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,469,288,400
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,608,091,200
第46回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,796,277,000
第47回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,851,305,100
第48回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,869,799,500
第49回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,747,488,000
第50回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,535,192,700
第51回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,466,974,800
第52回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,445,377,500
第53回利付国債(30年)	1,320,000,000	1,210,756,800
第54回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,647,261,200
第55回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,375,876,800
第56回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,410,750,800
第57回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,340,811,300

第58回利付国債(30年)	2,350,000,000	2,229,304,000	
第59回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,301,796,600	
第60回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,573,504,200	
第61回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,338,046,200	
第62回利付国債(30年)	480,000,000	416,496,000	
第63回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,372,345,900	
第64回利付国債(30年)	1,790,000,000	1,500,413,800	
第65回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,177,333,800	
第66回利付国債(30年)	1,010,000,000	846,986,000	
第67回利付国債(30年)	1,865,000,000	1,640,118,300	
第68回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,307,743,200	
第69回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,208,572,800	
第70回利付国債(30年)	1,780,000,000	1,599,134,200	
第71回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,282,352,500	
第72回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,029,376,500	
第73回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,674,435,400	
第74回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,682,388,600	
第75回利付国債(30年)	370,000,000	384,459,600	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	327,001,600	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	225,871,800	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	338,368,800	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	134,095,000	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	196,881,800	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	403,513,500	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	418,200,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	208,370,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	658,633,500	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	377,492,400	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	210,184,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	137,304,700	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	283,780,800	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	305,549,800	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	179,528,500	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	285,897,600	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	233,576,200	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	414,952,200	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	640,242,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	310,978,600	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	502,430,000	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	312,425,700	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	553,089,900	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,978,065,300	

第88回利付国債(20年)	420,000,000	457,909,200
第89回利付国債(20年)	350,000,000	380,247,000
第90回利付国債(20年)	630,000,000	687,619,800
第91回利付国債(20年)	450,000,000	492,997,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	961,188,800
第93回利付国債(20年)	410,000,000	447,802,000
第94回利付国債(20年)	610,000,000	669,029,700
第95回利付国債(20年)	610,000,000	677,362,300
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,750,240,200
第97回利付国債(20年)	900,000,000	999,504,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	486,411,200
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,431,603,300
第100回利付国債(20年)	480,000,000	537,494,400
第101回利付国債(20年)	715,000,000	808,593,500
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,431,549,000
第103回利付国債(20年)	400,000,000	452,136,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	178,996,800
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,325,340,600
第106回利付国債(20年)	380,000,000	429,103,600
第107回利付国債(20年)	760,000,000	857,166,000
第108回利付国債(20年)	870,000,000	970,267,500
第109回利付国債(20年)	520,000,000	582,067,200
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,245,684,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,108,826,400
第112回利付国債(20年)	790,000,000	897,700,700
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,301,446,600
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,661,162,900
第115回利付国債(20年)	700,000,000	804,566,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,718,700,100
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,237,680,000
第118回利付国債(20年)	660,000,000	754,135,800
第119回利付国債(20年)	530,000,000	597,400,100
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,745,384,700
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,707,420,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,062,491,400
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,166,282,800
第124回利付国債(20年)	610,000,000	701,640,300
第125回利付国債(20年)	1,770,000,000	2,072,705,400
第126回利付国債(20年)	730,000,000	842,514,900
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,168,603,800
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,114,927,700
第129回利付国債(20年)	740,000,000	844,132,800
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,472,224,500

第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,136,760,000	
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,322,318,800	
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,413,405,300	
第134回利付国債(20年)	830,000,000	956,077,000	
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,176,775,000	
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,642,980,500	
第137回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,212,608,200	
第138回利付国債(20年)	620,000,000	697,320,200	
第139回利付国債(20年)	830,000,000	941,502,200	
第140回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,771,698,600	
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,835,376,000	
第142回利付国債(20年)	980,000,000	1,134,046,200	
第143回利付国債(20年)	1,920,000,000	2,184,729,600	
第144回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,296,728,500	
第145回利付国債(20年)	2,675,000,000	3,075,688,250	
第146回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,108,564,000	
第147回利付国債(20年)	2,250,000,000	2,567,565,000	
第148回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,318,632,000	
第149回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,054,294,000	
第150回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,834,510,800	
第151回利付国債(20年)	2,445,000,000	2,681,064,750	
第152回利付国債(20年)	2,840,000,000	3,113,832,800	
第153回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,704,569,200	
第154回利付国債(20年)	2,655,000,000	2,908,101,150	
第155回利付国債(20年)	2,800,000,000	2,993,592,000	
第156回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,454,704,000	
第157回利付国債(20年)	2,950,000,000	2,833,711,000	
第158回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,604,858,300	
第159回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,504,775,200	
第160回利付国債(20年)	1,890,000,000	1,932,147,000	
第161回利付国債(20年)	1,990,000,000	2,002,258,400	
第162回利付国債(20年)	630,000,000	632,620,800	
第163回利付国債(20年)	1,980,000,000	1,982,772,000	
第164回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,299,342,000	
第165回利付国債(20年)	2,150,000,000	2,111,278,500	
第166回利付国債(20年)	1,820,000,000	1,838,582,200	
第167回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,159,457,300	
第168回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,352,204,100	
第169回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,870,182,100	
第170回利付国債(20年)	2,240,000,000	2,098,521,600	
第171回利付国債(20年)	1,670,000,000	1,559,546,200	
第172回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,282,559,200	

	第173回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,218,917,000	
	第174回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,334,374,400	
	第175回利付国債(20年)	2,030,000,000	1,938,853,000	
	第176回利付国債(20年)	2,850,000,000	2,713,912,500	
	第177回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,183,290,200	
	第178回利付国債(20年)	1,960,000,000	1,858,060,400	
	第179回利付国債(20年)	2,935,000,000	2,775,981,700	
	第180回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,405,927,100	
	第181回利付国債(20年)	800,000,000	811,600,000	
	国債証券合計	509,400,000,000	526,177,156,100	
地方債証券	第2回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	100,000,000	100,107,000	
	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,530,000	
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	88,352,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,078,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	125,238,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	122,836,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	118,797,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	116,374,000	
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	222,714,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,857,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,899,000	
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	88,617,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	226,440,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	226,290,000	
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,832,000	
	第726回東京都公募公債	200,000,000	201,900,000	
	第728回東京都公募公債	100,000,000	100,843,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,112,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,546,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,340,000	
	第781回東京都公募公債	300,000,000	299,910,000	
	第800回東京都公募公債	200,000,000	197,272,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,598,000	
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,108,000	
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,651,000	
	平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	199,996,000	
	第29回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	100,782,000	
	第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	256,598,000	
	第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,623,000	
	第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	226,418,000	
	第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,484,000	

第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,896,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,730,000	
第78回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	199,962,000	
第201回神奈川県公募公債	200,250,000	201,739,860	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	202,006,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	101,325,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,531,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,478,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,340,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	197,200,000	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	226,396,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	227,192,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	112,912,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,849,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,105,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	152,638,350	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,488,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,477,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,196,560	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,500,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,972,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,030,000	
第465回大阪府公募公債(10年)	160,000,000	157,516,800	
第468回大阪府公募公債(10年)	182,000,000	179,158,980	
第469回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	196,782,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	113,592,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	113,234,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	100,845,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,490,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	96,473,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	99,652,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	138,436,055	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	111,289,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	101,416,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	106,881,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,799,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,800,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	456,748,000	
平成25年度第7回兵庫県公募公債	100,000,000	100,814,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,093,000	

第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	98,199,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	297,384,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	110,306,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	93,226,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	112,907,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	111,527,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,169,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,388,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,484,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,453,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	307,563,400	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	113,910,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,096,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	202,274,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,156,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,038,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,034,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	297,315,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,128,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	91,928,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	197,290,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,834,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	175,924,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	113,006,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	226,650,000	
平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	100,829,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,028,302	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,317,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	387,012,600	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	111,115,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	112,525,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	97,362,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	227,976,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	194,690,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	226,418,000	

第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	193,252,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,018,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,447,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,085,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,714,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,365,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	98,612,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	98,531,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	147,516,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	111,198,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	111,607,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	105,307,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	114,566,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	106,023,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	121,997,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,985,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,937,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,431,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	91,928,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	98,902,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	296,901,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	98,703,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	96,200,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	225,050,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	113,503,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	112,907,000	
平成25年度第8回千葉県公募公債	300,000,000	302,472,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	100,919,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,014,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	101,440,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,085,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,502,800	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	295,698,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,811,000	
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	297,114,000	
令和4年度第1回長野県公募公債(10年)	200,000,000	199,230,000	
第1回群馬県公募公債(20年)	200,000,000	224,600,000	

平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	100,375,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,782,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,811,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,126,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,972,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,072,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,293,600	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,185,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,136,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,093,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,190,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,036,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,902,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,314,858	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,501,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,175,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,107,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,076,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,924,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,008,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,894,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,419,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,696,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,682,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,443,782	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,426,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,300,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,579,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,442,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,424,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	99,712,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	227,488,000	
第15回大阪市公募公債(30年)	100,000,000	87,666,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	300,000,000	290,763,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	100,196,000	
平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,085,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	197,490,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	124,403,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	127,125,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	111,732,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	115,130,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	100,593,000	

第512回名古屋市公募公債(10年)	300,000,000	296,790,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,838,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	131,382,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	225,306,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	114,301,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	113,444,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	87,549,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	87,856,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	106,060,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	339,054,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,396,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,612,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,187,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,632,000	
第30回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	220,964,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	296,913,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	98,746,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	106,280,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,954,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	112,292,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,366,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	98,455,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,996,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,473,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,088,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	113,234,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	111,885,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	202,264,000	
平成30年度第10回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,006,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	151,480,500	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,020,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,385,350	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,707,200	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	543,532,000	
令和2年度第3回広島市公募公債(5年)	200,000,000	199,904,000	
令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	197,132,000	
令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	296,889,000	

	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	99,381,000	
	平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,146,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	201,488,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	99,669,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	111,071,000	
	地方債証券合計	32,411,680,000	33,403,054,997	
特殊債券	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,150,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,014,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,479,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	79,652,000	
	第21回道路債券	100,000,000	124,260,000	
	第27回道路債券	400,000,000	415,056,000	
	第28回道路債券	200,000,000	251,594,000	
	第33回道路債券	200,000,000	254,696,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,127,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	136,304,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,764,000	
	第42回道路債券	100,000,000	105,601,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,189,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,978,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,558,000	
	第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	228,340,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,183,000	
	第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,312,000	
	第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,770,000	
	第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,989,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,029,000	
	第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,060,000	
	第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,990,000	
	第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,660,000	

第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,902,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,002,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,248,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,456,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,597,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	592,902,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	149,333,480	
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,851,000	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	265,800,000	268,115,118	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,912,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,142,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	533,000,000	538,863,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,168,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	223,944,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	103,177,080	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,218,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,194,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	222,352,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,191,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,105,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,382,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,279,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,866,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,112,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,458,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	86,519,000	
	107,000,000	106,794,560	

第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,498,150	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,342,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,590,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,301,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	120,466,800	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,126,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	296,928,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	214,905,220	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,809,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,467,000	
第2回公営企業債券(30年)	300,000,000	363,519,000	
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	100,000,000	106,066,000	
第5回公営企業債券(30年)	300,000,000	377,031,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,437,000	
第7回公営企業債券(30年)	200,000,000	251,898,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	41,406,400	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	124,131,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	226,700,000	
第10回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	222,420,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	600,000,000	600,072,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	200,000,000	171,842,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,575,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	227,298,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	112,695,000	
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	500,000,000	564,385,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	105,889,350	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	707,028,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,030,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,139,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,270,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,093,000	

第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,102,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,812,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,944,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,253,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,015,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,178,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,983,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,150,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,798,180	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,185,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,344,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,299,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,430,100	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,464,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	156,608,400	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,420,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,586,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,736,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,065,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,890,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,546,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,782,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,755,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,858,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,385,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,806,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	105,376,000	
第19回水資源債券(サステナビリティボンド)	200,000,000	199,818,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	113,345,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	115,420,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,018,900	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,345,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,890,800	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	187,721,820	
第54回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	220,026,400	
第87回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,908,000	
第88回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,940,000	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,961,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	207,420,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	148,810,000	

第161回都市再生債券	100,000,000	81,776,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	175,042,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,997,000	
第16回政府保証民間都市開発債券	180,000,000	181,492,200	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,857,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	9,939,000	9,962,754	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,337,000	10,428,482	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,439,000	10,551,114	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	128,475,000	127,502,444	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	89,544,000	88,808,843	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	109,945,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,370,000	10,471,937	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,298,000	11,482,948	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	159,501,000	157,866,114	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,114,000	11,290,045	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	182,121,000	179,950,117	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	64,936,000	64,295,081	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,579,000	11,825,864	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	219,006,000	216,150,161	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	9,913,000	9,935,601	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	151,398,000	149,514,608	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,714,000	11,985,179	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,229,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,529,000	16,269,733	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,629,000	16,418,420	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,492,000	18,501,988	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,237,000	20,262,139	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,141,000	22,401,637	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,658,000	22,924,343	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,990,000	47,497,292	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,160,000	10,265,054	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,438,000	21,469,914	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,369,000	10,455,788	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,952,000	9,977,974	

第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,735,000	21,763,248	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,369,000	21,407,004	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,209,000	20,135,450	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,268,000	11,488,965	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,668,000	42,413,877	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,484,000	22,433,377	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,903,000	11,077,338	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,496,000	29,767,491	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,228,000	28,419,225	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,400,000	28,622,314	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,100,000	62,665,068	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,814,000	76,545,118	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,027,000	39,395,972	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,802,000	40,520,540	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,041,000	40,816,975	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,219,000	35,655,855	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,467,000	34,623,954	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,974,000	40,783,173	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	172,308,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,018,000	105,543,742	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,056,000	142,818,932	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,564,000	40,849,038	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,896,000	42,247,612	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,792,000	43,052,864	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,758,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,111,000	136,028,091	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,499,000	46,663,774	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,332,000	97,106,128	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,199,000	54,341,182	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,971,000	58,009,011	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,425,000	57,731,238	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,951,000	179,639,686	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,952,000	120,949,160	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,224,000	58,567,619	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,899,000	63,348,674	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,172,000	67,625,942	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,856,000	73,419,511	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,534,000	72,927,344	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,859,000	73,560,609	

第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,394,000	74,402,927	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,763,000	74,641,883	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,601,000	76,408,731	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,053,000	76,931,256	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,040,000	76,705,646	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,942,000	76,604,224	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,707,000	77,390,732	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,366,000	156,369,873	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,843,000	77,476,359	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,022,000	158,592,640	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,964,000	78,580,234	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,302,000	157,238,210	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,096,000	79,681,102	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,226,000	160,099,030	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,304,000	161,135,411	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,705,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,890,000	81,696,739	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,590,000	81,572,866	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,782,000	81,092,577	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,784,000	166,598,247	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,555,000	83,361,928	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,834,000	82,770,146	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,890,000	167,462,271	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,340,000	84,494,050	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	260,622,000	253,697,273	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,762,000	170,076,630	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,009,000	87,819,839	

第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,603,000	88,159,495
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,272,000	182,681,732
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,146,000	92,184,733
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,338,000	184,355,363
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,928,000	185,575,141
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,458,000	92,523,420
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,952,000	186,809,251
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,310,000	187,920,464
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,118,000	94,319,008
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,624,000	95,134,057
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	289,524,000	285,013,216
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,910,000	95,515,465
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,399,000	98,208,105
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,179,000	99,040,149
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,302,000
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	199,652,000
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	93,998,000
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	87,666,000
第64回日本学生支援債券	300,000,000	299,922,000
第65回日本学生支援債券	200,000,000	199,940,000
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	105,634,000
第24回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	600,600,000
い第823号商工債	200,000,000	200,282,000
い第829号商工債	200,000,000	200,164,000
い第832号商工債	200,000,000	199,832,000
い第833号商工債	100,000,000	99,891,000
い第843号商工債	200,000,000	199,968,000
い第847号商工債	100,000,000	99,848,000
い第850号商工債	200,000,000	199,564,000
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,028,000
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,682,000
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,746,000
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,655,000

	第385回信金中金債(5年)	100,000,000	99,503,000	
	第254号商工債(3年)	300,000,000	299,880,000	
	第2回信金中金債(10年)	100,000,000	101,280,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	113,790,000	
	第53回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,066,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,729,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,406,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	494,805,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,441,000	
	第60回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,880,000	
	第63回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,884,000	
	第66回西日本高速道路株式会社社債	800,000,000	800,208,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,712,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,903,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	195,306,000	
	特殊債券合計	36,136,035,000	37,068,639,056	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,813,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	298,581,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,639,000	
	第8回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,113,000	
	第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,955,000	
	第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,913,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,611,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,480,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,101,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,864,000	
	第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	199,756,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,126,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	299,241,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,343,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,099,000	
	第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,722,000	
	第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,154,000	

第13回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,760,000	
第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,987,000	
第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,450,000	
第8回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,532,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,932,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,950,000	
第10回J.フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	99,221,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,229,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,508,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,929,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,289,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	100,126,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,873,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,930,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	198,918,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,076,000	
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,448,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	93,681,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,680,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,706,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,081,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	199,856,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	291,690,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,120,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,762,000	
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,477,000	
第19回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	93,884,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,738,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,638,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,827,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,193,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,966,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,104,000	

第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,969,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,048,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,330,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,822,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	106,340,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,122,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,640,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,081,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,245,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,199,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,458,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,938,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,836,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,599,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,890,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,760,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,037,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,926,000	
第11回J.A.三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,984,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,708,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,476,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,912,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,929,000	
第8回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	94,967,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,628,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	92,573,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,131,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,790,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	113,343,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	197,506,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,642,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,783,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,913,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	98,700,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	114,938,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	109,471,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	100,882,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,806,000	

第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	302,367,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,542,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,750,000	
第16回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,608,000	
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,442,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,075,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,934,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,840,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,930,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,836,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,047,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,987,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,366,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,101,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,324,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,004,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,800,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,221,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,044,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,752,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,644,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,022,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,981,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,102,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,777,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,563,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,659,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	800,000,000	800,000,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,370,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	199,332,000	

第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,594,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,824,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,361,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,248,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,255,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,312,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	97,909,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,708,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,817,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	98,959,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	90,736,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	94,302,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,734,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,168,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	93,975,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	85,890,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,025,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,490,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,808,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	224,538,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,145,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,143,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	93,504,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,409,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	88,885,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	93,052,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	85,170,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,287,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	88,889,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,117,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	498,835,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	92,899,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	123,288,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,066,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,325,000	

第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,157,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	80,323,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	74,722,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	87,130,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	94,282,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	172,242,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,541,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,898,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,831,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	396,776,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	186,684,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	95,579,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	94,724,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,582,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,057,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,967,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	91,472,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,356,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,856,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,014,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,952,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,022,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,534,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,014,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,355,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,908,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,930,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,178,000	
第442回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,985,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,303,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,201,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,736,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	127,606,500	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,934,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,609,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	195,376,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	96,264,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,445,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,465,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,038,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,846,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,416,000	

第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,703,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,848,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,543,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,926,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,098,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,651,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	96,216,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	96,780,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,192,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,314,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,223,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,100,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,556,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,778,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	298,626,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,793,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,904,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,297,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	281,625,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	98,205,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	88,353,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	195,952,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	195,338,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	93,062,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	200,114,000	
社債券合計	29,226,000,000	28,925,988,500	
合計		625,574,838,653	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2022年 8月22日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	12,298,373,133
コール・ローン	410,471,451
株式	548,259,636,236
投資信託受益証券	271,655,388
投資証券	13,588,810,491
派生商品評価勘定	1,035,780,797
未収入金	2,725,031
未収配当金	792,244,932
差入委託証拠金	4,112,329,900
流動資産合計	580,772,027,359
資産合計	580,772,027,359
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,594,043
前受金	1,031,536,579
未払金	37,660,165
未払解約金	811,364,813
未払利息	172
流動負債合計	1,887,155,772
負債合計	1,887,155,772
純資産の部	
元本等	
元本	127,919,434,305
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	450,965,437,282
元本等合計	578,884,871,587
純資産合計	578,884,871,587
負債純資産合計	580,772,027,359

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 8月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p>

	2022年 8月22日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 8月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		127,919,434,305口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.5254円 (45,254円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2022年 8月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	2022年 8月22日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	133,932,817,817円
期中追加設定元本額	17,199,771,698円
期中一部解約元本額	23,213,155,210円
期末元本額	127,919,434,305円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,883,932,705円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,521,807円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	32,478,385,245円
世界経済インデックスファンド	11,054,912,877円

区分	2022年 8月22日現在
外国株式インデックス・オープン	887,679,418円
DCマイセレクション25	799,540,603円
DCマイセレクション50	3,653,376,516円
DCマイセレクション75	4,385,389,166円
DC外国株式インデックス・オープン	11,964,612,098円
DCマイセレクションS25	406,308,213円
DCマイセレクションS50	1,867,653,120円
DCマイセレクションS75	1,584,741,584円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	45,727,041円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	165,888,980円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	121,369,165円
DC世界経済インデックスファンド	9,938,556,892円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,403,519,183円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,617,563円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	4,723,159円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	26,270,175円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	14,249,099円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	50,530,039円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	11,368,951円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	31,477,956円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	267,358,879円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	170,422,131円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,249,498,550円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	104,489,403円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	24,375,793円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	160,049,181円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	52,678,013円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	989,546,670円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,091,730,020円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,135,813,920円
コア投資戦略ファンド（安定型）	581,693,447円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,362,981,916円
分散投資コア戦略ファンドA	1,498,580,570円
分散投資コア戦略ファンドS	8,284,923,063円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,330,558,289円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,117,000,464円
コア投資戦略ファンド（切替型）	598,401,219円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	593,544,295円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,084,413円
SMT インデックスバランス・オープン	157,680,071円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	364,714,867円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	17,036,972,998円
SMT 世界経済インデックス・オープン	202,420,911円

区分	2022年 8月22日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	776,482,580円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	142,626,758円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,022,935円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	198,712,853円
グローバル経済コア	643,351,922円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,816,244円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,685,282円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	472,763,498円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	80,500,147円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	52,589,215円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	42,664,679円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	16,199,299円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	22,561,478円
10資産分散投資ファンド	18,092円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	263,280,476円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	31,762,532円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	892,404,353円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,298,877,195円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	212,323,572円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	120,457,048円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	65,692,732円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	66,341,188円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	236,402,277円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	226,303,448円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	225,149,556円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	228,989,512円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	225,426,645円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	159,158,151円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 8月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,368,773,860
投資信託受益証券	3,917,234
投資証券	96,650,366
合計	4,268,206,260

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	15,052,874,741	-	16,084,411,320	1,031,536,579
合計		15,052,874,741	-	16,084,411,320	1,031,536,579

（注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2022年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	1,061,713,714	-	1,064,063,539	2,349,825
	アメリカドル	813,930,500	-	816,066,500	2,136,000
	ユーロ	84,283,133	-	84,317,521	34,388
	イギリスポンド	110,360,136	-	110,363,745	3,609
	オーストラリアドル	53,139,945	-	53,315,773	175,828
	合計		1,061,713,714	-	1,064,063,539

（注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	27,671	36.15	1,000,306.65	
	BAKER HUGHES CO	75,948	25.16	1,910,851.68	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	165.85	3,025,601.55	
	CHEVRON CORP	158,183	157.69	24,943,877.27	
	CONOCOPHILLIPS	105,873	105.14	11,131,487.22	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	30.30	1,939,200.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	68.51	3,443,038.56	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	130.39	1,729,884.13	
	EOG RESOURCES INC	47,936	118.75	5,692,400.00	
	EQT CORPORATION	27,026	47.70	1,289,140.20	
	EXXON MOBIL	343,717	94.08	32,336,895.36	
	HALLIBURTON CO	71,583	29.39	2,103,824.37	
	HESS CORP	22,781	116.63	2,656,948.03	
	KINDER MORGAN INC	168,208	18.72	3,148,853.76	
	MARATHON OIL CORP	57,281	24.46	1,401,093.26	
	MARATHON PETROLEUM CORP	45,012	100.45	4,521,455.40	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	74,379	71.29	5,302,478.91	
	ONEOK INC	35,533	63.95	2,272,335.35	
	PHILLIPS 66	38,237	88.44	3,381,680.28	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	242.00	4,410,208.00	
	SCHLUMBERGER	112,526	37.12	4,176,965.12	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	68.89	1,191,659.22	
	VALERO ENERGY CORP	32,597	118.55	3,864,374.35	
	WILLIAMS COS	98,553	34.93	3,442,456.29	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	263.70	4,625,561.70	
	ALBEMARLE CORP	9,440	270.02	2,548,988.80	
	ALCOA CORP	15,500	51.01	790,655.00	
	AMCOR PLC	126,534	12.48	1,579,144.32	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	197.05	1,308,017.90	
	BALL CORP	25,605	61.91	1,585,205.55	
	CELANESE CORP-SERIES A	8,582	114.67	984,097.94	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	103.50	1,710,544.50	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	17.79	764,970.00	
CORTEVA INC	58,500	61.33	3,587,805.00		
CROWN HOLDINGS INC	9,940	98.57	979,785.80		
DOW INC	60,585	55.49	3,361,861.65		
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	60.48	2,478,470.40		
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	98.61	1,092,105.75		
ECOLAB INC	21,208	171.78	3,643,110.24		
FMC CORP	10,507	111.44	1,170,900.08		

FREEMPORT-MCMORAN INC	119,600	30.45	3,641,820.00
INT'L PAPER CO	30,800	43.59	1,342,572.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,024	119.32	2,508,583.68
LINDE PLC	41,706	303.75	12,668,197.50
LYONDELLBASELL INDU-CL A	21,835	89.26	1,948,992.10
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,192	365.15	1,895,858.80
MOSAIC CO/THE	27,732	53.52	1,484,216.64
NEWMONT CORPORATION	65,704	43.53	2,860,095.12
NUCOR CORP	22,299	138.17	3,081,052.83
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	143.17	1,100,547.79
PPG INDUSTRIES INC	19,278	131.94	2,543,539.32
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	94.08	983,700.48
SEALED AIR CORP	11,690	57.44	671,473.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	244.58	4,822,873.02
STEEL DYNAMICS INC	15,552	81.80	1,272,153.60
VULCAN MATERIALS CO	10,247	175.66	1,799,988.02
WESTLAKE CORP	4,100	104.65	429,065.00
WESTROCK CO	21,356	41.59	888,196.04
3 M COMPANY	46,618	145.20	6,768,933.60
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	47.50	522,737.50
ALLEGION PLC	7,601	106.45	809,126.45
AMETEK INC	18,006	128.90	2,320,973.40
BOEING CO	45,184	162.92	7,361,377.28
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	42.48	2,895,351.84
CATERPILLAR	43,701	195.60	8,547,915.60
CUMMINS INC	11,214	228.58	2,563,296.12
DEERE&CO	23,765	369.66	8,784,969.90
DOVER CORP	12,041	137.87	1,660,092.67
EATON CORP	32,650	150.84	4,924,926.00
EMERSON ELECTRIC CO	48,687	88.68	4,317,563.16
FASTENAL CO	44,846	55.21	2,475,947.66
FORTIVE CORP	28,348	67.56	1,915,190.88
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	67.61	697,059.10
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	256.01	1,334,068.11
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	241.67	4,584,479.90
GENERAL ELECTRIC CO	89,763	77.72	6,976,380.36
GRAINGER (WW) INC	3,667	583.91	2,141,197.97
HEICO CORP	3,640	163.24	594,193.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	132.83	856,620.67
HONEYWELL INTL INC	55,841	201.56	11,255,311.96
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	37.60	1,187,934.40
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	235.49	829,395.78

IDEX CORP	5,916	215.54	1,275,134.64
ILLINOIS TOOL WORKS	24,918	213.70	5,324,976.60
INGERSOLL-RAND INC	31,562	51.82	1,635,542.84
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	52.27	925,179.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	57.26	3,246,012.14
KORNIT DIGITAL LTD	2,776	31.77	88,193.52
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	238.43	3,739,536.12
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	258.68	653,425.68
LOCKHEED MARTIN CORP	19,979	440.03	8,791,359.37
MASCO CORP	19,462	55.38	1,077,805.56
NORDSON CORP	4,121	244.30	1,006,760.30
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,122	490.75	5,948,871.50
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	79.41	2,688,663.78
OWENS CORNING	8,642	89.88	776,742.96
PACCAR INC	28,106	93.03	2,614,701.18
PARKER HANNIFIN CORP	10,579	295.76	3,128,845.04
PENTAIR PLC	14,533	49.38	717,639.54
PLUG POWER INC	41,884	26.82	1,123,328.88
QUANTA SERVICES INC	11,465	142.02	1,628,259.30
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	121,485	93.40	11,346,699.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	251.61	2,289,147.78
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	43.92	607,325.76
SMITH (A.O.) CORP	9,016	62.63	564,672.08
SNAP-ON INC	4,000	230.13	920,520.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	98.99	1,247,076.02
TEXTRON	16,934	66.05	1,118,490.70
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	163.71	3,051,226.98
TRANSDIGM GROUP INC	4,347	646.00	2,808,162.00
UNITED RENTALS INC	6,022	316.69	1,907,107.18
WABTEC CORP	15,024	93.56	1,405,645.44
XYLEM INC	15,077	99.53	1,500,613.81
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	99.00	1,125,036.00
CINTAS CORP	7,423	436.52	3,240,287.96
CLARIVATE PLC	27,357	12.34	337,585.38
COPART INC	16,617	128.24	2,130,964.08
COSTAR GROUP INC	32,116	71.74	2,304,001.84
EQUIFAX INC	9,509	208.69	1,984,433.21
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	135.92	1,449,043.12
LEIDOS HOLDINGS	11,220	102.58	1,150,947.60
REPUBLIC SERVICES INC	18,296	146.44	2,679,266.24
ROBERT HALF INTL INC	9,566	81.39	778,576.74
ROLLINS INC	17,468	36.54	638,280.72

TRANSUNION	15,741	80.05	1,260,067.05
VERISK ANALYTICS INC	13,315	200.57	2,670,589.55
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	141.87	3,018,284.25
WASTE MANAGEMENT INC	33,891	174.32	5,907,879.12
AMERCO	734	578.53	424,641.02
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	117.12	1,203,642.24
CSX CORP	179,261	33.83	6,064,399.63
DELTA AIR LINES INC	14,609	33.25	485,749.25
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	107.19	1,529,815.68
FEDEX CORP	20,314	231.73	4,707,363.22
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	3.44	285,557.84
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	189.75	1,338,117.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,697	55.47	759,772.59
LYFT INC-A	21,288	16.65	354,445.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	255.75	4,881,500.25
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	297.04	2,377,211.12
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	37.88	512,630.04
UBER TECHNOLOGIES INC	120,334	29.01	3,490,889.34
UNION PACIFIC CORP	51,838	238.52	12,364,399.76
UNITED PARCEL SERVICE B	59,627	208.43	12,428,055.61
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	49.12	352,436.00
APTIV PLC	22,415	103.77	2,326,004.55
BORGWARNER INC	19,781	38.93	770,074.33
FORD MOTOR COMPANY	321,972	15.88	5,112,915.36
GENERAL MOTORS CO	109,933	39.70	4,364,340.10
LEAR CORP	5,287	145.17	767,513.79
LUCID GROUP INC	31,234	16.75	523,169.50
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	34.45	460,355.35
TESLA INC	71,259	890.00	63,420,510.00
DR HORTON INC	27,764	74.28	2,062,309.92
GARMIN LTD	12,854	97.13	1,248,509.02
HASBRO INC	10,572	84.00	888,048.00
LENNAR CORP-CL A	20,844	83.84	1,747,560.96
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	322.47	3,000,583.35
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	118.24	492,233.12
NEWELL BRANDS INC	31,461	20.84	655,647.24
NIKE B	103,874	113.16	11,754,381.84
NVR INC	247	4,273.29	1,055,502.63
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	11.71	254,528.56
PULTE GROUP INC	21,609	42.31	914,276.79
VF CORP	25,718	45.55	1,171,454.90
WHIRLPOOL CORP	5,220	168.24	878,212.80

AIRBNB INC-CLASS A	26,610	114.76	3,053,763.60
ARAMARK	20,955	37.57	787,279.35
BOOKING HOLDINGS INC	3,339	2,086.92	6,968,225.88
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	46.71	820,227.60
CARNIVAL CORPORATION	84,361	9.87	832,643.07
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,303	1,672.26	3,851,214.78
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	129.07	1,382,597.84
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	405.20	1,154,009.60
EXPEDIA GROUP INC	11,638	108.79	1,266,098.02
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	135.48	2,964,031.44
LAS VEGAS SANDS CORP	29,096	37.63	1,094,882.48
MARRIOTT INTL A	22,091	161.38	3,565,045.58
MCDONALD'S CORP	60,458	266.54	16,114,475.32
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	34.73	1,002,794.02
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	39.65	664,811.55
STARBUCKS CORP	93,796	86.92	8,152,748.32
VAIL RESORTS INC	3,014	238.25	718,085.50
WYNN RESORTS LTD	9,302	63.67	592,258.34
YUM BRANDS INC	22,637	116.65	2,640,606.05
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	80.27	4,948,083.61
ALPHABET INC-CL A	487,975	117.21	57,195,549.75
ALPHABET INC-CL C	460,933	118.12	54,445,405.96
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	18.02	689,985.80
CABLE ONE INC	445	1,332.13	592,797.85
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	454.46	4,457,798.14
COMCAST CORP-CL A	367,926	38.68	14,231,377.68
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	18.39	370,227.48
ELECTRONIC ARTS INC	23,158	130.48	3,021,655.84
FOX CORP - CLASS A	27,658	35.68	986,837.44
FOX CORP- CLASS B	10,345	32.91	340,453.95
IAC INC	6,721	69.32	465,899.72
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	30.17	1,020,771.78
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	114.43	1,289,397.24
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	68.85	1,058,844.15
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	42.91	582,889.44
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	43.04	274,767.36
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,343	94.28	1,163,698.04
MATCH GROUP INC	22,730	61.87	1,406,305.10
META PLATFORMS INC-CLASS A	187,450	167.96	31,484,102.00
NETFLIX INC	36,196	241.16	8,729,027.36
NEWS CORP-CLASS A	33,479	17.90	599,274.10
OMNICOM GROUP	16,538	72.49	1,198,839.62

PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	25.90	1,258,377.40
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	21.77	996,347.59
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	42.68	1,197,558.12
ROKU INC	9,122	74.15	676,396.30
SEA LTD-ADR	28,338	67.67	1,917,632.46
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.40	386,995.20
SNAP INC - A	83,375	11.56	963,815.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	127.74	1,643,630.58
THE WALT DISNEY CO	148,022	120.14	17,783,363.08
TWITTER INC	63,066	43.99	2,774,273.34
WARNER BROS DISCOVERY INC	175,398	13.73	2,408,214.54
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	49.35	1,082,492.25
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	207.02	1,102,174.48
AMAZON.COM	742,757	138.23	102,671,300.11
AUTOZONE INC	1,639	2,332.09	3,822,295.51
BATH & BODY WORKS INC	19,806	38.66	765,699.96
BEST BUY COMPANY INC	18,175	79.53	1,445,457.75
BURLINGTON STORES INC	5,108	163.31	834,187.48
CARMAX INC	13,591	96.27	1,308,405.57
CARVANA CO	5,700	42.30	241,110.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	42.78	294,240.84
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	253.86	4,743,627.96
DOLLAR TREE INC	17,931	167.68	3,006,670.08
DOORDASH INC - A	15,171	64.99	985,963.29
EBAY	46,820	47.07	2,203,817.40
ETSY INC	10,294	107.01	1,101,560.94
GENUINE PARTS CO	11,319	159.85	1,809,342.15
HOME DEPOT	84,800	321.32	27,247,936.00
LKQ CORP	22,779	56.07	1,277,218.53
LOWES COMPANIES	54,553	211.36	11,530,322.08
MERCADOLIBRE INC	3,725	909.76	3,388,856.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	736.55	3,982,525.85
POOL CORP	3,304	380.39	1,256,808.56
ROSS STORES INC	28,076	91.01	2,555,196.76
TARGET (DAYTON HUDSON)	39,126	167.04	6,535,607.04
TJX COMPANIES INC	97,454	66.40	6,470,945.60
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	203.29	1,813,753.38
ULTA BEAUTY INC	4,315	403.25	1,740,023.75
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	57.01	342,060.00
COSTCO WHOLESALE CORP	36,032	554.53	19,980,824.96
KROGER CO	56,126	49.50	2,778,237.00
SYSCO CORP	40,288	86.68	3,492,163.84

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	38.22	2,284,294.74
WALMART INC	124,048	137.02	16,997,056.96
ALTRIA GROUP INC	148,393	45.47	6,747,429.71
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,772	87.23	3,905,461.56
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	77.24	1,854,223.44
BUNGE LIMITED	11,604	100.02	1,160,632.08
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	51.31	814,238.39
COCA-COLA CO	334,608	65.17	21,806,403.36
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	53.75	827,427.50
CONAGRA BRANDS INC	40,304	35.40	1,426,761.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	251.69	3,256,868.60
GENERAL MILLS INC	49,534	77.97	3,862,165.98
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	233.18	2,802,590.42
HORMEL FOODS CORP	23,338	51.07	1,191,871.66
JM SMUCKER CO	9,145	139.77	1,278,196.65
KELLOGG CO	21,630	76.67	1,658,372.10
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	39.96	2,483,713.80
KRAFT HEINZ CO/THE	58,511	38.53	2,254,428.83
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	91.78	1,908,106.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	56.09	822,784.21
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	113,286	65.36	7,404,372.96
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	90.59	2,923,067.53
PEPSICO INC	112,413	180.17	20,253,450.21
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	126,117	100.13	12,628,095.21
TYSON FOODS INC	23,306	81.75	1,905,265.50
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	88.70	1,715,990.20
CLOROX COMPANY	9,570	148.87	1,424,685.90
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	83.27	5,311,626.76
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,016	273.28	5,196,692.48
KIMBERLY-CLARK CORP	26,841	136.95	3,675,874.95
PROCTER & GAMBLE CO	194,633	149.73	29,142,399.09
ABBOTT LABORATORIES	143,383	110.06	15,780,732.98
ABIOMED INC	3,781	270.68	1,023,441.08
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	269.82	1,603,540.26
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	152.03	1,960,578.88
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	61.25	2,450,796.25
BECTON DICKINSON & CO	23,274	264.53	6,156,671.22
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,818	42.02	4,908,692.36
CARDINAL HEALTH	21,902	69.23	1,516,275.46
CENTENE CORP	46,422	96.90	4,498,291.80
CIGNA CORP	26,188	292.98	7,672,560.24
CVS HEALTH CORP	106,862	104.05	11,118,991.10

DAVITA INC	4,627	93.21	431,282.67
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	35.78	635,953.72
DEXCOM INC	30,588	85.11	2,603,344.68
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49,627	98.55	4,890,740.85
ELEVANCE HEALTH INC	19,661	503.54	9,900,099.94
HCA HEALTHCARE INC	19,440	215.03	4,180,183.20
HENRY SCHEIN INC	11,747	76.41	897,588.27
HOLOGIC INC	19,018	71.46	1,359,026.28
HUMANA INC	10,365	499.86	5,181,048.90
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	373.74	2,523,118.74
INSULET CORP	5,311	267.42	1,420,267.62
INTUITIVE SURGICAL INC	29,197	224.78	6,562,901.66
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	249.31	1,893,509.45
MASIMO CORP	4,147	155.72	645,770.84
MCKESSON CORP	12,089	371.01	4,485,139.89
MEDTRONIC PLC	109,343	95.00	10,387,585.00
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	331.71	1,507,621.95
NOVOCURE LTD	7,933	79.24	628,610.92
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	135.48	1,355,477.40
RESMED INC	11,440	233.49	2,671,125.60
STERIS PLC	8,018	209.89	1,682,898.02
STRYKER CORP	27,055	218.14	5,901,777.70
TELADOC HEALTH INC	11,375	32.90	374,237.50
TELEFLEX INC	3,934	242.18	952,736.12
THE COOPER COS INC	4,134	322.69	1,334,000.46
UNITEDHEALTH GROUP INC	76,357	548.32	41,868,070.24
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	107.98	658,893.96
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	219.21	2,467,208.55
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	113.23	1,843,497.63
ABBVIE INC	143,718	141.85	20,386,398.30
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	137.62	3,273,291.70
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	215.97	2,082,598.71
AMGEN	45,347	250.86	11,375,748.42
AVANTOR INC	48,633	26.55	1,291,206.15
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	510.20	945,400.60
BIO-TECHNE CORP	3,245	354.83	1,151,423.35
BIOGEN INC	11,860	214.09	2,539,107.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	92.84	1,372,453.72
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	177,351	75.33	13,359,850.83
CATALENT INC	13,739	105.24	1,445,892.36
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	217.59	914,748.36
DANAHER CORP	55,252	292.44	16,157,894.88

ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	17.47	629,985.67
EXACT SCIENCES CORP	14,756	36.83	543,463.48
GILEAD SCIENCES INC	99,836	65.34	6,523,284.24
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	60.40	1,082,730.40
ILLUMINA INC	12,506	202.75	2,535,591.50
INCYTE CORP	15,212	74.54	1,133,902.48
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	239.02	3,615,416.52
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	156.65	778,707.15
JOHNSON & JOHNSON	213,402	169.31	36,131,092.62
LILLY (ELI) & CO	65,773	322.77	21,229,551.21
MERCK & CO	205,447	92.08	18,917,559.76
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,333.80	2,411,510.40
MODERNA INC	27,309	146.10	3,989,844.90
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	107.00	906,718.00
PERKINELMER INC	10,545	145.13	1,530,395.85
PFIZER	456,781	49.15	22,450,786.15
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,497	618.36	5,254,204.92
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	44.10	1,152,244.80
SEAGEN INC	10,981	171.67	1,885,108.27
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	10.37	833,758.37
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,791	588.55	18,710,593.05
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,811	299.04	6,223,321.44
VIATRIS INC	90,748	10.57	959,206.36
WATERS CORP	4,749	327.98	1,557,577.02
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	319.52	1,842,671.84
ZOETIS INC	38,534	169.52	6,532,283.68
BANK OF AMERICA CORP	591,261	35.48	20,977,940.28
CITIGROUP	161,792	52.61	8,511,877.12
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	38.98	1,540,567.56
FIFTH THIRD BANCORP	52,803	36.54	1,929,421.62
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	839.78	797,791.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	163.54	2,254,725.98
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	14.08	1,606,696.96
JPMORGAN CHASE & CO	240,076	118.63	28,480,215.88
KEY CORP	71,472	19.30	1,379,409.60
M & T BANK CORP	14,037	188.82	2,650,466.34
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,513	170.79	5,894,475.27
REGIONS FINL CORP	79,314	22.60	1,792,496.40
SIGNATURE BANK	4,686	189.96	890,152.56
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	435.39	1,978,847.55
TRUIST FINANCIAL CORP	105,758	50.63	5,354,527.54
US BANCORP	112,247	48.61	5,456,326.67

WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	49.10	700,804.30
WELLS FARGO & CO	310,526	45.35	14,082,354.10
ALLY FINANCIAL INC	27,761	35.16	976,076.76
AMERICAN EXPRESS	52,626	162.24	8,538,042.24
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	284.74	2,477,807.48
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	58.13	1,851,673.02
BANK NEW YORK CO	61,254	43.89	2,688,438.06
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,127	297.28	31,252,154.56
BLACKROCK INC	12,394	713.85	8,847,456.90
BLACKSTONE INC	57,841	103.30	5,974,975.30
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	112.21	3,731,655.76
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	33.56	525,851.64
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	123.78	1,098,547.50
CME GROUP INC	29,373	202.07	5,935,402.11
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	74.06	709,198.56
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	106.91	2,502,014.73
EQUITABLE HOLDINGS INC	34,355	31.28	1,074,624.40
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	446.37	1,405,172.76
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	27.71	722,399.70
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	38.37	165,604.92
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,736	349.27	9,687,352.72
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	109.09	4,876,650.27
INVESCO LTD	26,420	18.10	478,202.00
KKR & CO INC	44,282	54.09	2,395,213.38
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	224.39	1,432,954.54
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	262.31	841,228.17
MOODY'S CORP	13,365	310.89	4,155,044.85
MORGAN STANLEY	108,856	90.01	9,798,128.56
MSCI INC	6,518	478.49	3,118,797.82
NASDAQ INC	9,657	187.11	1,806,921.27
NORTHERN TRUST CORP	15,902	100.56	1,599,105.12
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	126.42	2,263,802.94
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	108.89	1,686,270.54
S&P GLOBAL INC	28,938	379.92	10,994,124.96
SCHWAB (CHARLES) CORP	118,155	73.86	8,726,928.30
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	57.70	551,035.00
STATE STREET CORP	30,359	72.26	2,193,741.34
SYNCHRONY FINANCIAL	41,566	34.31	1,426,129.46
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	72.99	661,362.39
UPSTART HOLDINGS INC	3,148	28.46	89,592.08
AFLAC	50,591	63.68	3,221,634.88
ALLEGHANY CORP	1,080	842.19	909,565.20

ALLSTATE CORP	22,174	130.20	2,887,054.80
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	135.10	853,696.90
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	56.10	3,696,877.80
AON PLC	17,038	299.87	5,109,185.06
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	47.28	1,405,445.28
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	190.70	3,119,661.30
ASSURANT INC	4,726	171.85	812,163.10
BROWN & BROWN INC	19,873	67.27	1,336,856.71
CHUBB LTD	34,810	200.58	6,982,189.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	103.88	1,328,729.08
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	221.06	478,815.96
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	281.50	925,572.00
FNF GROUP	20,461	40.78	834,399.58
GLOBE LIFE INC	8,106	103.97	842,780.82
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	68.81	1,907,482.01
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	49.47	667,053.48
LOEWS CORP	16,741	58.24	974,995.84
MARKEL CORP	1,156	1,249.25	1,444,133.00
MARSH & MCLENNAN COS	41,045	171.78	7,050,710.10
METLIFE INC	57,127	67.39	3,849,788.53
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	78.15	1,619,189.85
PROGRESSIVE CORP	48,534	127.48	6,187,114.32
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,511	103.40	3,051,437.40
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	172.64	3,413,438.08
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,385	216.26	2,029,600.10
WR BERKLEY CORP	17,572	67.59	1,187,691.48
CBRE GROUP INC-A	27,714	84.92	2,353,472.88
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.91	484,617.00
WEYERHAEUSER CO	58,295	36.20	2,110,279.00
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	33.62	451,415.74
ACCENTURE PLC-CL A	51,384	315.29	16,200,861.36
ADOBE INC	38,347	425.05	16,299,584.08
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	30.92	396,270.72
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	97.04	1,326,827.92
ANSYS INC	6,794	271.62	1,845,386.28
APPLOVIN CORP-CLASS A	10,000	26.93	269,300.00
AUTODESK INC	17,467	222.59	3,887,979.53
AUTOMATIC DATA PROCESS	34,246	259.82	8,897,795.72
AVALARA INC	6,847	91.81	628,623.07
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	38.97	545,424.12
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	174.29	1,297,240.47
BLACK KNIGHT INC	11,543	67.26	776,382.18

BLOCK INC	41,288	74.36	3,070,175.68
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	176.03	1,714,884.26
CADENCE DESIGN SYSTEMS	22,740	188.04	4,276,029.60
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	64.84	691,713.12
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	123.79	1,005,669.96
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	102.77	1,073,329.88
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	68.53	1,389,993.99
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	43,220	68.60	2,964,892.00
COUPA SOFTWARE INC	6,059	67.77	410,618.43
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,760	190.52	3,002,595.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	151.04	468,224.00
DATADOG INC - CLASS A	18,646	105.73	1,971,441.58
DOCUSIGN INC	14,969	65.92	986,756.48
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	23.44	540,713.92
DYNATRACE INC	14,790	39.63	586,127.70
EPAM SYSTEMS INC	4,403	442.55	1,948,547.65
FAIR ISAAC CORP	2,125	489.79	1,040,803.75
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	49,912	100.10	4,996,191.20
FISERV INC	49,921	109.48	5,465,351.08
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	235.08	1,410,950.16
FORTINET INC	56,318	51.29	2,888,550.22
GARTNER INC	6,340	307.98	1,952,593.20
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	132.81	2,997,123.27
GODADDY INC - CLASS A	13,798	81.08	1,118,741.84
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	77.03	486,675.54
HUBSPOT INC	3,646	351.58	1,281,860.68
INTL BUSINESS MACHINES CORP	73,262	138.37	10,137,262.94
INTUIT INC	21,909	463.95	10,164,680.55
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	204.27	1,285,062.57
MASTERCARD INC-CLASS A	70,879	354.28	25,111,012.12
MICROSOFT CORP	577,361	286.15	165,211,850.15
MONGODB INC	5,325	337.07	1,794,897.75
NORTONLIFELOCK INC	43,549	23.54	1,025,143.46
OKTA INC	11,505	96.21	1,106,896.05
ORACLE CORP	130,499	78.66	10,265,051.34
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	8.51	1,065,826.44
PALO ALTO NETWORKS INC	8,079	513.51	4,148,647.29
PAYCHEX INC	26,693	138.49	3,696,713.57
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	377.01	1,596,637.35
PAYPAL HOLDINGS INC	90,208	96.56	8,710,484.48
PTC INC	8,304	119.50	992,328.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	45.55	291,201.15

ROPER TECHNOLOGIES INC	8,672	433.32	3,757,751.04
SALESFORCE INC	80,094	183.77	14,718,874.38
SERVICENOW INC	16,309	476.26	7,767,324.34
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,680	153.94	2,721,659.20
SPLUNK INC	13,355	109.22	1,458,633.10
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	61.07	1,180,788.45
SYNOPSYS INC	12,539	363.00	4,551,657.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	65.69	2,408,917.99
TWILIO INC - A	12,842	76.04	976,505.68
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	397.30	1,326,584.70
UNITY SOFTWARE INC	16,329	47.67	778,403.43
VERISIGN INC	7,790	201.47	1,569,451.30
VISA INC-CLASS A SHARES	134,653	212.82	28,656,851.46
VMWARE INC-CLASS A	16,717	121.58	2,032,452.86
WESTERN UNION CO	29,297	16.43	481,349.71
WIX.COM LTD	5,010	69.46	347,994.60
WORKDAY INC-CLASS A	15,615	168.18	2,626,130.70
ZENDESK INC	8,890	76.55	680,529.50
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	99.50	1,694,286.00
ZSCALER INC	6,234	166.22	1,036,215.48
AMPHENOL CORPORATION	47,707	79.21	3,778,871.47
APPLE INC	1,323,029	171.52	226,925,934.08
ARISTA NETWORKS INC	20,350	130.00	2,645,500.00
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	112.71	687,531.00
CDW CORP/DE	10,882	188.37	2,049,842.34
CISCO SYSTEMS	337,789	48.70	16,450,324.30
COGNEX CORP	14,352	46.04	660,766.08
CORNING	64,989	36.19	2,351,951.91
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	47.67	1,071,669.27
F5 INC	4,851	171.54	832,140.54
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	98,742	14.86	1,467,306.12
HP INC	83,910	34.23	2,872,239.30
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	29.73	752,793.33
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	176.23	2,641,511.47
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,836	253.25	3,503,967.00
NETAPP INC	18,303	74.29	1,359,729.87
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	79.97	1,326,142.51
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	134.87	3,515,791.16
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	397.11	1,548,331.89
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	70.01	1,482,531.76
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	47.67	1,229,409.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	328.41	1,366,842.42

AT&T INC	581,626	18.43	10,719,367.18
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	20.95	325,060.20
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	22.19	609,936.53
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	11.06	815,885.14
T-MOBILE US INC	50,968	146.37	7,460,186.16
VERIZON COMMUNICATIONS	341,350	44.42	15,162,767.00
AES CORP	54,375	25.58	1,390,912.50
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	64.04	1,330,623.12
AMEREN CORPORATION	20,898	97.35	2,034,420.30
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,156	104.94	4,213,970.64
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	157.81	2,236,798.94
ATMOS ENERGY CORP	10,802	118.01	1,274,744.02
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	32.65	1,572,489.30
CMS ENERGY CORP	23,697	70.94	1,681,065.18
CONSOLIDATED EDISON INC	29,197	100.55	2,935,758.35
CONSTELLATION ENERGY	25,732	80.84	2,080,174.88
DOMINION ENERGY INC	64,535	85.62	5,525,486.70
DTE ENERGY COMPANY	15,851	136.14	2,157,955.14
DUKE ENERGY CORP	62,802	113.24	7,111,698.48
EDISON INTL	30,339	71.54	2,170,452.06
ENTERGY CORP	16,181	121.65	1,968,418.65
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	51.75	1,055,648.25
EVERGY INC	18,475	71.33	1,317,821.75
EVERSOURCE ENERGY	28,450	93.63	2,663,773.50
EXELON CORP	77,196	46.14	3,561,823.44
FIRSTENERGY CORP	45,165	41.27	1,863,959.55
NEXTERA ENERGY INC	159,643	89.71	14,321,573.53
NISOURCE INC	32,351	31.54	1,020,350.54
NRG ENERGY INC	19,068	42.95	818,970.60
PG&E CORP	118,132	12.13	1,432,941.16
PPL CORPORATION	58,459	30.81	1,801,121.79
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	69.40	2,739,079.20
SEMPRA ENERGY	25,885	170.06	4,402,003.10
SOUTHERN CO	86,558	80.16	6,938,489.28
UGI CORP	18,019	41.40	745,986.60
VISTRA CORP	37,797	25.25	954,374.25
WEC ENERGY GROUP INC	26,033	107.69	2,803,493.77
XCEL ENERGY INC	43,741	76.94	3,365,432.54
ADVANCED MICRO DEVICES	132,978	95.95	12,759,239.10
ANALOG DEVICES	42,691	168.00	7,172,088.00
APPLIED MATERIALS	72,040	104.63	7,537,545.20
BROADCOM INC	33,289	548.43	18,256,686.27

	ENPHASE ENERGY INC	11,020	283.70	3,126,374.00
	ENTEGRIS INC	12,483	102.90	1,284,500.70
	INTEL CORP	331,419	35.38	11,725,604.22
	KLA CORP	12,119	371.81	4,505,965.39
	LAM RESEARCH CORP	11,398	476.79	5,434,452.42
	MARVELL TECHNOLOGY INC	67,204	53.14	3,571,220.56
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	70.84	3,137,432.76
	MICRON TECHNOLOGY	91,511	60.51	5,537,330.61
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	511.65	1,806,636.15
	NVIDIA CORP	202,894	178.49	36,214,550.06
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	180.33	3,759,519.84
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	72.53	2,499,964.04
	QORVO INC	8,556	103.70	887,257.20
	QUALCOMM	91,671	147.60	13,530,639.60
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	108.11	1,445,646.92
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,214	300.33	1,265,590.62
	TERADYNE INC	12,318	96.85	1,192,998.30
	TEXAS INSTRUMENTS	75,121	176.45	13,255,100.45
	アメリカドル 小計	27,588,693		2,982,138,048.55 (409,059,876,119)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	18.27	1,002,292.20
	CAMECO CORP	31,793	29.27	930,581.11
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,374	72.39	6,976,513.86
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	23.64	2,630,966.52
	ENBRIDGE	165,402	56.25	9,303,862.50
	IMPERIAL OIL	16,573	61.54	1,019,902.42
	KEYERA CORP	18,607	31.97	594,865.79
	PARKLAND CORP	14,075	34.13	480,379.75
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	48.61	2,219,824.26
	SUNCOR ENERGY	116,208	42.39	4,926,057.12
	TC ENERGY CORP	77,328	64.25	4,968,324.00
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	77.98	1,950,201.82
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	56.82	2,065,634.28
	BARRICK GOLD CORP	139,009	20.86	2,899,727.74
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	65.06	854,823.34
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	24.13	1,037,590.00
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	167.01	2,565,774.63
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	8.78	455,216.66
	KINROSS GOLD CORP	108,451	4.58	496,705.58
	LUNDIN MINING CORP	62,243	6.87	427,609.41
	NUTRIEN LTD	44,786	117.41	5,258,324.26
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	20.92	385,158.12

TECK RESOURCES LTD-CL B	40,179	44.20	1,775,911.80
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	120.63	735,843.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	41.50	1,420,877.00
CAE INC	25,999	26.15	679,873.85
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	106.43	807,271.55
WSP GLOBAL INC	9,951	161.62	1,608,280.62
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	37.54	506,977.70
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	91.61	938,544.45
THOMSON REUTERS CORP	13,293	150.30	1,997,937.90
AIR CANADA	13,805	18.45	254,702.25
CANADIAN NATL RAILWAY CO	48,612	164.73	8,007,854.76
CP RAILWAY LIMITED	75,991	106.14	8,065,684.74
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	132.60	773,986.20
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	80.78	1,880,719.96
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	102.09	313,416.30
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	41.89	715,439.31
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	76.81	1,772,237.13
QUEBECOR INC -CL B	15,200	29.50	448,400.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	35.23	1,247,917.06
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	168.94	762,426.22
DOLLARAMA INC	22,000	80.35	1,767,700.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	59.06	3,984,601.02
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	39.89	608,442.17
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	123.59	1,595,917.67
METRO INC	18,840	72.37	1,363,450.80
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	161.42	843,580.92
SAPUTO INC	20,898	33.90	708,442.20
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	7.08	147,264.00
BANK MONTREAL	53,040	133.89	7,101,525.60
BANK NOVA SCOTIA	99,336	81.24	8,070,056.64
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,829	67.81	4,870,724.49
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	94.25	2,571,988.25
ROYAL BANK OF CANADA	115,288	129.05	14,877,916.40
TORONTO-DOMINION BANK	148,462	87.45	12,983,001.90
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	116,005	67.11	7,785,095.55
IGM FINANCIAL INC	7,685	37.52	288,341.20
ONEX CORP	6,603	67.46	445,438.38
TMX GROUP LTD	4,685	134.05	628,024.25
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	667.60	1,423,990.80
GREAT-WEST LIFE CO INC	23,788	33.27	791,426.76
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	72.71	734,298.29
INTACT FINANCIAL CORP	15,012	195.54	2,935,446.48

	MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	24.16	3,739,436.48	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	35.55	1,549,162.35	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	61.73	2,821,184.46	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	174.35	469,001.50	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	8.30	327,020.00	
	CGI INC - CL A	18,300	108.46	1,984,818.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	2,139.45	3,431,677.80	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	26.18	217,189.28	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	42.09	181,029.09	
	OPEN TEXT CORP	20,463	49.63	1,015,578.69	
	SHOPIFY INC - CLASS A	92,560	44.43	4,112,440.80	
	BCE INC	6,203	66.04	409,646.12	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,167	58.97	1,543,067.99	
	TELUS CORP	32,908	30.74	1,011,591.92	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.55	961,223.90	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	29.43	717,944.85	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	52.88	597,279.60	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	41.18	425,142.32	
	EMERA INC	23,223	62.83	1,459,101.09	
	FORTIS INC	36,823	60.32	2,221,163.36	
	HYDRO ONE LTD	23,269	36.05	838,847.45	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	45.18	806,643.72	
	カナダドル 小計	3,313,371		195,531,501.71 (20,624,662,800)	
ユーロ	ENI	197,669	11.77	2,326,564.13	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	10.80	428,349.60	
	NESTE OIL OYJ	36,735	49.78	1,828,668.30	
	OMV AG	12,549	40.22	504,720.78	
	REPSOL SA	111,112	13.07	1,452,789.40	
	TENARIS SA	40,648	12.96	527,001.32	
	TOTALENERGIES SE	203,322	52.69	10,713,036.18	
	AIR LIQUIDE	43,239	136.50	5,902,123.50	
	AKZO NOBEL	15,301	66.78	1,021,800.78	
	ARCELORMITTAL	48,641	23.21	1,129,200.81	
	ARKEMA	4,369	87.76	383,423.44	
	BASF SE	73,837	43.03	3,177,575.29	
	COVESTRO AG	14,454	31.48	455,011.92	
	CRH PLC	59,653	38.40	2,290,675.20	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	19.94	319,857.96	
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	48.69	634,966.29	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	142.80	1,957,359.60	
	OCI NV	12,000	37.40	448,800.00	

SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	35.95	701,168.80
SOLVAY SA	5,356	83.48	447,118.88
STORA ENSO OYJ R	42,169	15.53	655,095.41
SYMRISE AG	11,830	112.90	1,335,607.00
UMICORE	17,605	33.19	584,309.95
UPM KYMMENE OYJ	42,324	34.45	1,458,061.80
VOESTALPINE AG	7,152	20.54	146,902.08
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	22,552	23.88	538,541.76
AIRBUS SE	46,955	106.24	4,988,499.20
ALSTOM	24,388	21.90	534,097.20
BOUYGUES ORD	16,606	30.48	506,150.88
BRENTAG SE	12,514	69.76	872,976.64
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.44	1,008,368.57
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	27.09	904,647.86
DASSAULT AVIATION SA	2,130	147.30	313,749.00
EIFFAGE	5,924	90.98	538,965.52
FERROVIAL SA	43,631	26.83	1,170,619.73
GEA GROUP AG	13,382	37.04	495,669.28
IMCD NV	4,641	151.40	702,647.40
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	61.00	756,278.00
KION GROUP AG	5,887	41.60	244,899.20
KNORR-BREMSE AG	5,022	52.92	265,764.24
KONE OYJ-B	26,311	41.15	1,082,697.65
LEGRAND SA	21,768	79.28	1,725,767.04
MTU AERO ENGINES AG	3,962	191.20	757,534.40
PRYSMIAN SPA	21,155	32.05	678,017.75
RATIONAL AG	483	591.50	285,694.50
RHEINMETALL AG	3,660	168.15	615,429.00
SAFRAN SA	28,774	109.92	3,162,838.08
SAINT-GOBAIN	40,093	43.23	1,733,220.39
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,670	134.50	6,008,115.00
SIEMENS	61,200	108.20	6,621,840.00
SIEMENS ENERGY AG	36,841	15.90	585,771.90
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	17.96	403,044.77
THALES SA	8,524	125.10	1,066,352.40
VINCI S.A.	42,507	93.79	3,986,731.53
WARTSILA OYJ	41,917	8.64	362,414.38
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.95	675,717.35
RANDSTAD NV	10,558	47.79	504,566.82
TELEPERFORMANCE	4,734	310.10	1,468,013.40
WOLTERS KLUWER	20,839	106.75	2,224,563.25
ADP	2,382	140.40	334,432.80

AENA SME SA	5,508	126.05	694,283.40
ATLANTIA SPA	35,937	22.84	820,801.08
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.27	284,527.32
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	39.45	3,105,267.30
GETLINK	35,220	19.64	691,720.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	75.81	1,979,171.67
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	71.20	355,359.20
CONTINENTAL AG	8,168	63.06	515,074.08
FERRARI NV	10,170	205.30	2,087,901.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	64,434	58.09	3,742,971.06
MICHELIN	55,356	25.79	1,427,908.02
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	67.76	795,841.20
RENAULT SA	17,362	29.31	508,880.22
STELLANTIS NV	175,794	14.44	2,539,168.53
VALEO SA	16,596	19.97	331,505.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,874	145.76	2,313,794.24
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	193.35	480,668.10
ADIDAS AG	13,972	165.60	2,313,763.20
ESSILORLUXOTTICA	22,910	161.70	3,704,547.00
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,396.50	3,545,713.50
KERING	6,271	558.10	3,499,845.10
LVMH	22,668	698.30	15,829,064.40
MONCLER SPA	19,057	48.89	931,696.73
PUMA SE	9,220	65.72	605,938.40
SEB SA	2,282	78.15	178,338.30
ACCOR	14,436	25.36	366,096.96
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	127.60	1,664,924.80
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	34.24	277,617.92
SODEXO	6,027	81.40	490,597.80
BOLLORE SE	83,646	4.74	396,816.62
PUBLICIS GROUPE	17,077	50.88	868,877.76
SCOUT24 SE	7,492	56.90	426,294.80
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	43.99	311,053.29
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	20.84	1,276,304.12
VIVENDI SE	61,243	8.98	550,084.62
D' IETEREN GROUP	2,217	161.80	358,710.60
DELIVERY HERO SE	13,414	50.68	679,821.52
INDITEX	87,326	24.78	2,163,938.28
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	20.95	326,311.26
PROSUS	66,706	62.86	4,193,139.16
ZALANDO SE	17,664	26.61	470,039.04
CARREFOUR	52,544	17.40	914,528.32

HELLOFRESH SE	13,805	28.14	388,472.70
JERONIMO MARTINS	24,901	23.00	572,723.00
KESKO OYJ-B SHS	20,083	22.34	448,654.22
KONINKLIJKE AHOLD NV	86,170	28.30	2,438,611.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,711	52.37	3,598,395.07
DANONE (GROUPE)	51,543	53.65	2,765,281.95
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	10.39	509,910.03
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	76.10	704,001.10
HEINEKEN NV	20,157	96.08	1,936,684.56
JDE PEET'S BV	7,000	31.76	222,320.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	106.75	1,393,087.50
PERNOD-RICARD	16,694	195.40	3,262,007.60
REMY COINTREAU	1,382	191.40	264,514.80
BEIERSDORF AG	7,430	103.35	767,890.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	65.15	572,017.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	66.56	961,059.84
LOREAL	19,843	362.15	7,186,142.45
AMPLIFON SPA	11,650	28.71	334,471.50
BIOMERIEUX	3,044	100.10	304,704.40
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	133.25	457,047.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	135.45	280,381.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	36.15	614,007.75
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	24.62	829,423.18
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	18.56	1,332,346.84
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	449.20	819,340.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	49.91	1,076,408.97
ARGENX SE	3,976	380.60	1,513,265.60
BAYER	78,757	54.40	4,284,380.80
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	74.88	765,273.60
GRIFOLS SA	27,685	13.22	365,995.70
IPSEN	3,532	97.15	343,133.80
MERCK KGAA	10,555	182.00	1,921,010.00
ORION OYJ-CLASS B	9,854	47.29	465,995.66
QIAGEN N.V.	17,038	46.86	798,400.68
RECORDATI SPA	9,859	43.29	426,796.11
SANOFI	93,369	81.66	7,624,512.54
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,539	391.80	994,780.20
UCB (GROUPE)	9,389	73.38	688,964.82
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	9.86	393,700.90
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	4.69	2,511,195.87
BANCO SANTANDER SA	1,393,640	2.53	3,528,696.48
BNP PARIBAS	92,730	47.66	4,419,511.80

CAIXABANK	330,447	2.98	986,053.84
COMMERZBANK AG	81,889	6.71	549,475.19
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	9.58	952,958.64
ERSTE GROUP BANK AG	31,905	23.11	737,324.55
FINECOBANK SPA	53,120	11.48	610,083.20
ING GROEP NV-CVA	324,888	9.11	2,959,729.68
INTESA SANPAOLO	1,322,943	1.77	2,345,842.52
KBC GROEP NV	18,608	49.17	914,955.36
MEDIOBANCA	53,990	8.28	447,469.12
SOCIETE GENERALE	63,329	22.52	1,426,485.72
UNICREDIT SPA	168,352	9.64	1,623,755.04
AMUNDI SA	4,626	53.40	247,028.40
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	8.49	1,364,568.04
DEUTSCHE BOERSE	14,999	170.80	2,561,829.20
EURAZEO SA	3,357	63.15	211,994.55
EURONEXT NV	6,480	76.88	498,182.40
EXOR NV	7,825	65.04	508,938.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	79.72	678,815.80
SOFINA	1,238	210.40	260,475.20
WENDEL	2,023	84.00	169,932.00
AEGON	148,741	4.72	702,801.22
AGEAS	11,086	42.38	469,824.68
ALLIANZ SE-REG	32,696	176.02	5,755,149.92
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	15.10	1,293,118.70
AXA SA	154,335	24.26	3,744,167.10
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	147.65	639,767.45
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,889	233.80	2,779,648.20
NN GROUP NV	22,611	42.01	949,888.11
POSTE ITALIANE SPA	46,035	8.20	377,487.00
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	44.95	1,737,542.25
AROUNDTOWN SA	64,068	3.08	197,393.50
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	80.86	426,536.50
VONOVIA SE	59,080	29.10	1,719,228.00
ADYEN NV	1,746	1,617.80	2,824,678.80
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	55.98	1,991,992.32
BECHTLE AG	7,659	44.73	342,587.07
CAPGEMINI SA	13,877	186.20	2,583,897.40
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	42.53	2,244,180.51
EDENRED	18,664	52.58	981,353.12
NEMETSCHKE SE	5,455	66.94	365,157.70
NEXI SPA	48,458	8.86	429,434.79
SAP SE	85,927	91.30	7,845,135.10

WORLDLINE SA	20,332	42.77	869,599.64	
NOKIA OYJ	427,600	4.98	2,133,082.60	
CELLNEX TELECOM SA	46,824	42.53	1,991,424.72	
DEUTSCHE TELEKOM	258,113	18.89	4,877,303.24	
ELISA A	10,227	55.46	567,189.42	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.04	304,965.00	
KPN (KON.)	282,927	3.24	917,532.26	
ORANGE	153,815	10.37	1,596,292.07	
PROXIMUS	13,141	13.51	177,534.91	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.21	184,406.99	
TELEFONICA	431,420	4.25	1,833,535.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.67	263,569.05	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	23.79	226,314.27	
ACCIONA SA	2,181	207.00	451,467.00	
E.ON SE	195,549	9.19	1,797,877.50	
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	26.07	559,618.62	
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.92	471,090.32	
ELIA GROUP SA/NV	3,125	156.70	489,687.50	
ENAGAS	21,663	19.41	420,478.83	
ENDESA	25,972	18.16	471,651.52	
ENEL	650,125	5.00	3,252,575.37	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	5.12	1,157,661.38	
ENGIE	141,564	12.93	1,831,555.03	
FORTUM OYJ	32,550	10.94	356,259.75	
IBERDROLA SA	477,647	10.94	5,225,458.18	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	29.08	291,090.80	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	19.62	602,055.75	
RWE STAMM	49,680	43.08	2,140,214.40	
SNAM SPA	147,559	5.09	751,075.31	
TERNA SPA	102,810	7.59	781,150.38	
UNIPER SE	7,335	6.47	47,494.12	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	24.13	1,231,281.51	
VERBUND AG	6,430	109.10	701,513.00	
ASM INTERNATIONAL NV	3,483	300.00	1,044,900.00	
ASML HOLDING NV	33,005	545.10	17,991,025.50	
INFINEON TECHNOLOGIES	110,035	26.21	2,884,017.35	
STMICROELECTRONICS	55,076	36.62	2,016,883.12	
	14,873,040		346,426,948.75	
			(47,651,026,800)	
ユーロ 小計				
イギリスポンド				
BP PLC	1,596,790	4.47	7,150,425.62	
SHELL PLC-NEW	620,239	22.48	13,946,073.91	
ANGLO AMERICAN PLC	102,156	28.42	2,903,784.30	

ANTOFAGASTA PLC	35,856	11.30	405,352.08
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	72.12	787,838.88
GLENCORE PLC	817,868	4.87	3,984,243.96
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	21.63	364,422.24
MONDI PLC	36,710	15.70	576,347.00
RIO TINTO PLC REG	89,551	49.11	4,398,297.36
ASHTED GROUP PLC	37,687	45.38	1,710,236.06
BAE SYSTEMS PLC	260,104	8.03	2,088,635.12
BUNZL PLC	24,880	31.45	782,476.00
DCC PLC	6,622	51.80	343,019.60
FERGUSON PLC	17,761	104.45	1,855,136.45
MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.45	464,476.09
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.81	516,739.65
SMITHS GROUP PLC	26,476	15.92	421,630.30
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	111.85	616,740.90
EXPERIAN PLC	74,115	28.66	2,124,135.90
INTERTEK GROUP PLC	13,890	42.76	593,936.40
RELX PLC	154,242	24.37	3,758,877.54
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.40	759,153.92
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.62	338,559.25
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	39.08	300,447.04
BURBERRY GROUP PLC	29,776	18.15	540,434.40
PERSIMMON PLC	25,686	16.70	428,956.20
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.19	314,415.81
COMPASS GROUP PLC	142,427	19.50	2,778,038.63
ENTAIN PLC	49,630	13.19	654,619.70
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	50.26	744,400.86
WHITBREAD PLC	17,434	25.86	450,843.24
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.75	489,118.50
INFORMA PLC	110,598	5.82	643,901.55
PEARSON	55,305	8.79	486,241.56
WPP PLC	95,821	8.15	781,324.43
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.24	256,566.41
KINGFISHER PLC	153,717	2.39	368,767.08
NEXT PLC	11,468	61.64	706,887.52
OCADO GROUP PLC	54,753	8.77	480,183.81
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.19	325,595.32
TESCO PLC	601,050	2.70	1,628,244.45
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	16.12	414,928.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	178,799	34.65	6,196,279.34
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	20.96	376,441.60
DIAGEO	189,615	39.60	7,508,754.00

IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	19.10	1,453,128.00	
HALEON PLC	405,046	2.56	1,037,322.80	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,022	66.74	3,805,648.28	
UNILEVER PLC	209,465	40.04	8,386,978.60	
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.39	712,702.05	
ASTRAZENECA	126,291	112.50	14,207,737.50	
GSK PLC	334,172	14.25	4,762,619.34	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	14.38	236,690.79	
BARCLAYS	1,339,545	1.65	2,213,999.97	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,655,458	5.36	8,886,498.54	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,667,831	0.44	2,540,321.85	
NATWEST GROUP PLC	443,701	2.61	1,161,609.21	
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.82	1,238,135.28	
3I GROUP PLC	74,757	12.40	926,986.80	
ABRDN PLC	153,430	1.58	243,186.55	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	9.52	315,110.55	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	85.60	2,251,023.20	
M&G PLC	229,107	2.06	472,418.63	
SCHRODERS PLC	11,794	28.72	338,723.68	
ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	12.21	499,804.14	
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.22	377,441.10	
AVIVA PLC	225,378	4.37	984,901.86	
LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.70	1,244,049.30	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.61	337,116.61	
PRUDENTIAL	230,270	9.58	2,207,828.76	
AVEVA GROUP PLC	10,917	22.86	249,562.62	
SAGE GROUP PLC	76,660	7.42	568,817.20	
HALMA PLC	31,069	22.89	711,169.41	
BT GROUP PLC	557,358	1.57	876,445.45	
VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.21	2,684,057.78	
NATIONAL GRID PLC	302,035	11.68	3,529,278.97	
SEVERN TRENT PLC	22,468	29.71	667,524.28	
SSE PLC	90,604	18.41	1,668,472.66	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	11.34	664,297.20	
イギリスポンド 小計	23,111,209		150,227,537.74 (24,348,879,316)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.26	317,687.48
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	728.50	418,159.00
	GIVAUDAN-REG	748	3,298.00	2,466,904.00
	HOLCIM LTD	44,847	45.55	2,042,780.85
	SIKA AG-BR	11,714	235.10	2,753,961.40
	ABB LTD	137,175	28.54	3,914,974.50

	GEBERIT AG-REG	2,964	478.80	1,419,163.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	172.00	352,256.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	176.50	545,738.00
	VAT GROUP AG	1,956	255.40	499,562.40
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	32.12	335,654.00
	SGS SA	506	2,251.00	1,139,006.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	244.50	1,119,076.50
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,318	112.10	4,855,947.80
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	241.90	600,637.70
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	44.72	176,107.36
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,088.00	584,640.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	109,800.00	878,400.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,780.00	883,960.00
	NESTLE SA - REGISTERED	229,173	116.92	26,794,907.16
	ALCON INC	39,333	66.26	2,606,204.58
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,686	282.00	1,321,452.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	113.85	972,279.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	64.45	119,232.50
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	564.00	3,324,780.00
	NOVARTIS	179,027	82.01	14,682,004.27
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	384.20	851,003.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,316	323.35	18,533,128.60
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	5.04	1,076,528.77
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	48.27	912,158.19
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	980.20	1,796,706.60
	UBS GROUP AG	281,888	15.55	4,384,767.84
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	153.10	485,939.40
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	516.00	1,248,204.00
	SWISS RE LTD	24,445	74.74	1,827,019.30
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,053	428.40	5,163,505.20
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	87.65	497,764.35
	TEMENOS AG - REG	5,150	79.70	410,455.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	52.28	767,784.08
	SWISSCOM	2,187	512.60	1,121,056.20
	スイスフラン 小計	1,401,947		114,201,496.23 (16,326,245,901)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	357.05	7,945,076.60
	HOLMEN AB-B SHARES	10,000	461.80	4,618,000.00
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	161.75	7,098,722.25
	ALFA LAVAL AB	27,268	307.50	8,384,910.00
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	238.90	18,671,946.20
	ATLAS COPCO A	227,097	116.70	26,502,219.90

ATLAS COPCO B	127,608	104.48	13,332,483.84
EPIROC AB-A	53,479	173.15	9,259,888.85
EPIROC AB-B	28,804	155.15	4,468,940.60
HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	75.56	2,925,078.72
INDUTRADE AB	22,644	220.00	4,981,680.00
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	233.30	3,266,666.60
LIFCO AB-B SHS	17,970	178.00	3,198,660.00
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	100.90	12,395,363.20
SANDVIK AB	87,644	184.85	16,200,993.40
SKANSKA B	25,507	169.10	4,313,233.70
SKF AB-B	37,718	161.15	6,078,255.70
VOLVO AB-A SHS	13,514	185.50	2,506,847.00
VOLVO B	121,238	178.66	21,660,381.08
SECURITAS B	29,533	104.65	3,090,628.45
VOLVO CAR AB-B	49,839	71.16	3,546,543.24
ELECTROLUX AB-SER B	21,269	145.22	3,088,684.18
EVOLUTION AB	14,096	924.40	13,030,342.40
EMBRACER GROUP AB	53,147	74.90	3,980,710.30
HENNES & MAURITZ B	55,229	127.48	7,040,592.92
SWEDISH MATCH AB	127,270	107.10	13,630,617.00
ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	265.00	13,110,610.00
GETINGE AB-B SHS	17,796	215.70	3,838,597.20
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	242.60	3,477,671.00
NORDEA BANK ABP	279,221	102.42	28,597,814.82
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	111.90	14,686,315.50
SVENSKA HANDELSBK A	110,736	91.34	10,114,626.24
SWEDBANK AB-A	72,526	141.65	10,273,307.90
EQT AB	23,207	253.90	5,892,257.30
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	253.60	2,997,044.80
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	251.00	2,803,168.00
INVESTOR AB-A SHS	38,925	196.25	7,639,031.25
INVESTOR AB-B SHS	142,777	183.34	26,176,735.18
KINNEVIK AB - B	18,792	169.95	3,193,700.40
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	460.70	3,353,896.00
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	62.21	3,527,307.00
SAGAX AB-B	12,402	241.50	2,995,083.00
SINCH AB	44,150	20.00	883,000.00
ERICSSON (LM) B	225,508	80.84	18,230,066.72
HEXAGON AB-B SHS	153,838	119.00	18,306,722.00
TELE2 AB-B SHS	46,762	118.30	5,531,944.60
TELIA CO AB	230,643	38.74	8,935,109.82
	3,170,036		419,781,474.86

スウェーデンクローナ 小計				(5,436,170,099)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	27,755	340.40	9,447,802.00
	EQUINOR ASA	81,436	374.95	30,534,428.20
	NORSK HYDRO	96,800	67.14	6,499,152.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	419.90	5,247,910.20
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	351.60	3,039,582.00
	ADEVINTA ASA	19,117	76.10	1,454,803.70
	MOWI ASA	31,968	221.00	7,064,928.00
	ORKLA	69,804	84.50	5,898,438.00
	SALMAR ASA	5,423	701.50	3,804,234.50
	DNB BANK ASA	71,795	196.55	14,111,307.25
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	207.00	3,844,818.00
	TELENOR ASA	51,193	114.90	5,882,075.70
ノルウェークローネ 小計		495,008		96,829,479.55 (1,350,771,239)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	470.00	3,987,010.00
	NOVOZYMES A/S	17,111	457.00	7,819,727.00
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,666.50	1,258,207.50
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	81,654	191.56	15,641,640.24
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	19,440.00	4,257,360.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	19,665.00	8,534,610.00
	DSV A/S	15,307	1,219.00	18,659,233.00
	PANDORA A/S	8,163	485.50	3,963,136.50
	CARLSBERG AS-B	8,481	1,001.00	8,489,481.00
	COLOPLAST-B	9,208	907.60	8,357,180.80
	DEMANT A/S	8,512	239.00	2,034,368.00
	GN STORE NORD A/S	9,226	246.70	2,276,054.20
	GENMAB A/S	5,250	2,669.00	14,012,250.00
	NOVO NORDISK A/S-B	136,910	771.00	105,557,610.00
	DANSKE BANK A/S	56,132	100.85	5,660,912.20
	TRYG A/S	29,772	170.10	5,064,217.20
ORSTED A/S	15,439	784.50	12,111,895.50	
デンマーククローネ 小計		411,056		227,684,893.14 (4,212,170,523)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	34.14	704,274.06
	SANTOS	265,406	7.52	1,995,853.12
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	26.48	339,288.24
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	158,086	33.50	5,295,881.00
	BHP GROUP LTD	414,748	41.55	17,232,779.40
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	17.39	604,650.30
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	2.53	309,049.62
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	19.16	2,655,422.72

JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	36.49	1,348,232.52
MINERAL RESOURCES LTD	14,409	60.90	877,508.10
NEWCREST MINING LIMITED	73,939	19.35	1,430,719.65
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	7.72	784,568.16
ORICA LTD	38,288	15.61	597,675.68
RIO TINTO LTD	28,818	98.53	2,839,437.54
SOUTH32 LTD	341,133	4.19	1,429,347.27
REECE LTD	16,814	16.28	273,731.92
BRAMBLES LTD	108,007	12.97	1,400,850.79
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.95	472,384.45
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.70	399,500.00
TRANSURBAN GROUP	249,674	14.14	3,530,390.36
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	36.35	1,679,733.50
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	70.26	248,790.66
IDP EDUCATION LTD	17,793	27.87	495,890.91
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.47	813,598.11
REA GROUP LTD	3,586	130.59	468,295.74
SEEK LTD	28,001	22.95	642,622.95
WESFARMERS LTD	91,917	48.92	4,496,579.64
COLES GROUP LTD	108,486	19.36	2,100,288.96
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	8.32	914,376.32
WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	39.34	3,930,105.34
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	13.42	858,343.20
COCHLEAR LIMITED	4,783	218.86	1,046,807.38
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	73.40	1,192,603.20
SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	34.09	1,269,886.59
CSL LIMITED	38,619	294.67	11,379,860.73
AUST AND NZ BANKING GROUP	247,511	23.10	5,717,504.10
COMMONWEALTH BANK OF AUST	139,969	99.95	13,989,901.55
NATIONAL AUSTRALIA BANK	267,570	30.92	8,273,264.40
WESTPAC BANKING	283,793	22.18	6,294,528.74
ASX LTD	14,549	82.00	1,193,018.00
MACQUARIE GROUP LIMITED	29,434	182.28	5,365,229.52
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	236,496	4.57	1,080,786.72
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.65	847,467.95
QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.10	1,350,251.10
SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	11.08	1,051,093.12
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.39	1,082,330.64
WISETECH GLOBAL LTD	13,801	54.35	750,084.35
XERO LTD	11,340	88.80	1,006,992.00
TELSTRA CORP	308,467	4.12	1,270,884.04
ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	6.02	911,831.34

	オーストラリアドル 小計	5,421,068		126,244,495.70 (11,913,693,059)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.62	898,177.02
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	19.85	793,603.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.25	908,869.50
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.28	405,769.64
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.26	581,461.44
	ニュージーランドドル 小計	506,126		3,587,880.60 (304,431,668)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	52.30	11,191,990.80
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	103.50	11,074,500.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	15.84	2,724,480.00
	MTR CORP	125,000	41.60	5,200,000.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	23.85	2,862,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	45.95	7,995,300.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	16.80	3,326,400.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	16.36	2,817,192.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	23.25	3,392,175.00
	WH GROUP LTD	658,301	5.46	3,594,323.46
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	27.25	7,670,875.00
	HANG SENG BANK	59,400	126.10	7,490,340.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	334.20	32,016,360.00
	AIA GROUP LTD	982,200	75.40	74,057,880.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	54.25	8,923,908.00
	ESR GROUP LTD	157,000	20.20	3,171,400.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	13.22	2,287,060.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	28.15	3,525,168.20
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	26.50	3,613,937.50
	SINO LAND CO	315,400	12.02	3,791,108.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	95.95	10,362,600.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	56.00	2,268,000.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	18.92	1,820,104.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	37.90	4,510,100.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	50.40	3,402,000.00	
CLP HOLDINGS	137,500	69.35	9,535,625.00	
HONG KONG & CHINA GAS	904,657	8.17	7,391,047.69	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	49.55	5,549,600.00	
	香港ドル 小計	6,162,153		245,565,474.65 (4,292,484,496)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.97	786,216.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.93	579,282.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.39	583,909.48

	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.80	492,000.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.17	744,762.00	
	DBS GROUP	150,000	32.04	4,806,000.00	
	OCBC BANK	282,100	12.21	3,444,441.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	26.80	2,516,520.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	10.01	660,660.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.87	864,945.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.36	357,808.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.39	351,025.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.45	474,165.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.66	1,811,308.38	
	シンガポールドル 小計	2,774,575		18,473,041.86 (1,818,301,510)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	32.23	1,915,332.21	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	687.90	1,476,233.40	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	35.01	3,441,833.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	134,557	36.06	4,852,125.42	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	21.00	2,089,500.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	138.70	1,734,166.10	
	AZRIELI GROUP	4,323	292.00	1,262,316.00	
	NICE LTD	4,991	728.00	3,633,448.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	153.40	1,534,000.00	
	イスラエルシェケル 小計	425,757		21,938,954.23 (920,922,706)	
	合 計	89,654,039		548,259,636,236 (548,259,636,236)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	109,658	1,280,805.44	
		LENLEASE GROUP	64,786	673,774.40	
		オーストラリアドル 小計	174,444	1,954,579.84 (184,453,699)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,523,655.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,465,000.00	
		香港ドル 小計	535,500	4,988,655.00 (87,201,689)	
		投資信託受益証券合計	709,944	271,655,388 (271,655,388)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,110	1,975,746.50	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	939,272.14	

	AMERICAN TOWER CORPORATION	37,131	10,189,117.71	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	149,611	1,000,897.59	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,436,153.36	
	BOSTON PROPERTIES	11,259	972,214.65	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,102,682.70	
	CROWN CASTLE INC	35,305	6,359,842.70	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	3,054,230.85	
	DUKE REALTY CORP	30,517	1,937,524.33	
	EQUINIX INC	7,423	5,172,272.17	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,069,853.70	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,592	2,321,788.32	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,509,502.05	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	2,300,212.20	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	811,376.00	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,259,272.30	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,066,196.94	
	INVITATION HOMES INC	46,840	1,816,455.20	
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,280,130.88	
	KIMCO REALTY CORP	47,897	1,088,698.81	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	798,074.20	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,690,684.65	
	PROLOGIS INC	60,352	8,091,996.16	
	PUBLIC STORAGE	12,922	4,538,594.06	
	REALTY INCOME CORP	47,102	3,434,206.82	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	810,837.91	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,956,757.67	
	SIMON PROPERTY GROUP	27,091	3,007,371.91	
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,526,183.40	
	UDR INC	24,265	1,184,859.95	
	VENTAS INC	31,565	1,543,844.15	
	VICI PROPERTIES INC	75,321	2,607,613.02	
	VORNADO REALTY TRUST	11,390	329,171.00	
	WELLTOWER INC	35,629	2,835,355.82	
	WP CAREY INC	16,024	1,410,112.00	
	アメリカドル 小計	1,092,149	86,429,103.82 (11,855,480,170)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	228,271.77	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	329,782.10	
	カナダドル 小計	20,377	558,053.87 (58,863,522)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	287,547.90	
	GECINA SA	3,139	293,653.45	

	KLEPIERRE	17,225	372,060.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	586,630.05	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	425,128.88	
	ユーロ 小計	48,695	1,965,020.28 (270,288,539)	
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	368,004.47	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	327,355.80	
	SEGRO PLC	93,383	950,638.94	
	イギリスポンド 小計	219,086	1,645,999.21 (266,783,551)	
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	861,864.40	
	GOODMAN GROUP	133,807	2,741,705.43	
	GPT GROUP	167,884	715,185.84	
	MIRVAC GROUP	266,683	586,702.60	
	SCENTRE GROUP	382,183	1,062,468.74	
	STOCKLAND	207,412	773,646.76	
	VICINITY CENTERS	365,149	713,866.29	
	オーストラリアドル 小計	1,617,208	7,455,440.06 (703,569,878)	
香港ドル	LINK REIT	170,500	10,767,075.00	
	香港ドル 小計	170,500	10,767,075.00 (188,208,471)	
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	846,731.24	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	714,900.90	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	506,908.31	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	426,800.00	
	シンガポールドル 小計	1,127,756	2,495,340.45 (245,616,360)	
	投資証券合計	4,295,771	13,588,810,491 (13,588,810,491)	
	合計		13,860,465,879 (13,860,465,879)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
----	-----	--------------	------------------------	----------------	----------------

アメリカドル	株式	604銘柄	97.2%		72.8%
	投資証券	36銘柄		2.8%	2.1%
カナダドル	株式	86銘柄	99.7%		3.7%
	投資証券	2銘柄		0.3%	0.0%
ユーロ	株式	223銘柄	99.4%		8.5%
	投資証券	5銘柄		0.6%	0.0%
イギリスポンド	株式	79銘柄	98.9%		4.3%
	投資証券	3銘柄		1.1%	0.0%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.0%		2.9%
スウェーデンクローナ	株式	47銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式	12銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.0%		0.7%
オーストラリアドル	株式	50銘柄	93.1%		2.1%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.4%	0.0%
	投資証券	7銘柄		5.5%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式	28銘柄	94.0%		0.8%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.9%	0.0%
	投資証券	1銘柄		4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	88.1%		0.3%
	投資証券	4銘柄		11.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%		0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 8月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	488,650,275

	2022年 8月22日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	3,073,123,480
国債証券	313,183,995,292
派生商品評価勘定	29,199,906
未収利息	1,603,103,690
前払金	52,198,801
前払費用	87,310,264
差入委託証拠金	651,112,049
流動資産合計	319,168,693,757
資産合計	319,168,693,757
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	57,476,756
未払金	13,125,621
未払解約金	51,316,794
未払利息	1,292
流動負債合計	121,920,463
負債合計	121,920,463
純資産の部	
元本等	
元本	100,884,333,021
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	218,162,440,273
元本等合計	319,046,773,294
純資産合計	319,046,773,294
負債純資産合計	319,168,693,757

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 8月22日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2022年 8月22日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 8月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	100,884,333,021口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.1625円 (1万口当たり純資産額) (31,625円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

2022年 8月22日現在	
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	96,318,492,637円
期中追加設定元本額	18,604,179,241円
期中一部解約元本額	14,038,338,857円
期末元本額	100,884,333,021円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,292,123,305円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	559,423,914円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,193,319,725円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,397,000円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,317,897,419円
世界経済インデックスファンド	14,526,285,012円
DCマイセレクション25	1,951,915,745円
DCマイセレクション50	1,689,771,794円
DCマイセレクション75	1,151,485,333円
DC外国債券インデックス・オープン	2,302,222,409円
DCマイセレクションS25	962,740,722円
DCマイセレクションS50	762,983,084円
DCマイセレクションS75	431,780,316円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	30,255,602円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	93,475,951円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	47,973,411円
DC世界経済インデックスファンド	13,039,232,802円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	601,176,215円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,727,388円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,321,326円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	21,646,390円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	42,585,101円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	68,363,691円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	73,376,503円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	67,730,491円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,217,436,458円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	423,085,845円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,697,077,639円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	68,548,875円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	37,357,331円

区分	2022年 8月22日現在
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	425,126,579円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	162,744,780円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	206,642,380円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	735,049,745円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	2,744,647,142円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	688,811,698円
外国債券ファンド・シリーズ1	700,822,394円
コア投資戦略ファンド（安定型）	511,218,449円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,348,562,464円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	568,145,448円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,158,455,052円
コア投資戦略ファンド（切替型）	617,085,545円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	252,033,517円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	108,760,933円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,354,395,424円
S M T インデックスバランス・オープン	198,046,642円
外国債券 S M T B セレクション（S M A 専用）	15,485,538,331円
S M T 世界経済インデックス・オープン	267,590,104円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	334,304,501円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	533,950,288円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	5,383,067円
グローバル経済コア	860,118,900円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	17,263,639円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	1,745,578円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	199,453,093円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,400,351円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 3 0	19,698,374円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 4 0	19,801,239円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 5 0	8,454,671円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 6 0	12,814,250円
M y S M T グローバル債券インデックス（ノーロード）	22,850,826円
1 0 資産分散投資ファンド	7,886円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンド S（適格機関投資家専用）	260,153,594円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンド P（適格機関投資家専用）	10,999,921,911円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	331,588,907円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	301,486,907円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	357,125,601円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	997,961,657円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	88,166,476円
ファンドラップ運用戦略 F（中庸型）（適格機関投資家専用）	72,939,518円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 8月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		6,935,715,956
合計		6,935,715,956

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	3,314,152,687	-		3,261,953,886	52,198,801
	合計	3,314,152,687	-		3,261,953,886	52,198,801

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2022年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,120,832,449	-		3,144,754,400	23,921,951
	アメリカドル	1,758,124,045	-		1,785,567,200	27,443,155
	カナダドル	137,030,592	-		137,905,010	874,418
	ユーロ	1,041,651,984	-		1,038,385,475	3,266,509
	イギリスポンド	184,025,828	-		182,896,715	1,129,113
	合計	3,120,832,449	-		3,144,754,400	23,921,951

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,574,804.70	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,498,785.93	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,858,691.40	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,801,985.53	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,719,531.28	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,120,317.39	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,407,128.89	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,498,437.50	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,527,851.54	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,487,539.07	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,759,828.11	
		T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,617,031.28	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,834,375.00	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,272,625.00	
		T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,610,488.24	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,254,375.04	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,678,300.79	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,402,812.48	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,540,494.57	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,819,375.00	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,726,562.50	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,224,882.79	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,969,687.52	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,731,757.82	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,635,156.24	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,090,781.25	

T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,721,086.73	
T 0.5% 04/30/27	11,940,000.00	10,577,160.99	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,094,902.33	
T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,142,743.78	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,097,523.46	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,564,843.75	
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,700,195.35	
T 0.625% 05/15/30	12,000,000.00	10,068,750.00	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,239,687.52	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,967,980.52	
T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,805,957.82	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,198,535.15	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,775,781.30	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,498,925.76	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,072,734.43	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,742,656.25	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,649,218.76	
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,740,346.15	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,276,275.00	
T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,257,973.81	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,323,437.52	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,468,203.14	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,477,500.00	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,463,984.39	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	13,022,953.12	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,059,062.50	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,200,000.00	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,182,705.47	
T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	5,003,921.87	
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,103,650.83	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,655,720.71	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,225,312.48	
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,409,628.94	
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,213,125.04	
T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,553,710.98	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,468,508.77	
T 1.25% 08/15/31	19,380,000.00	16,777,326.65	
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	13,005,253.87	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,466,523.42	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,577,703.49	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,822,500.00	
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,403,289.11	

T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,454,150.40
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,921,328.12
T 1.375% 11/15/31	21,030,000.00	18,312,529.68
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,281,562.50
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,420,335.96
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,592,187.50
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,834,625.81
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,025,976.60
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,200,839.86
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,462,781.27
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,812,988.30
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,669,371.11
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,143,199.23
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	10,021,933.64
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,173,085.93
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,452,880.85
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,630,468.76
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,773,398.47
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,489,839.08
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,533,828.14
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,335,687.51
T 1.75% 08/15/41	12,330,000.00	9,322,635.93
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,766,328.14
T 1.875% 02/15/32	8,020,000.00	7,288,801.60
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	6,151,507.85
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,872,656.25
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,790,000.00
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,938,203.93
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,840,156.28
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	6,852,210.98
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,200,195.33
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,598,125.04
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,015,531.25
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,270,933.56
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,101,447.67
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,462,328.11
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,700,156.25
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,887,304.70
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,642,888.27
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,944,062.52
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,610,529.27
T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,859,585.94
T 2.25% 03/31/24	5,900,000.00	5,806,890.62

T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,253,613.30	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,886,386.71	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,359,276.59	
T 2.25% 08/15/27	3,030,000.00	2,909,273.43	
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,320,247.67	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,450,273.46	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,166,617.21	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,933,123.02	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,263,015.63	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,329,357.44	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,439,619.13	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,275,546.90	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,632,890.62	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,685,637.47	
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,688,304.71	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,524,843.75	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,299,115.62	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,668,323.43	
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	6,788,695.30	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,917,578.15	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	3,413,570.33	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,433,334.55	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,908,789.05	
T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,431,323.43	
T 2.5% 02/15/46	6,450,000.00	5,384,238.31	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,800,169.91	
T 2.5% 05/15/46	3,450,000.00	2,878,054.68	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,519,340.82	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,596,383.19	
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,977,839.81	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,132,753.94	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,471,767.56	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,705,191.42	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,978,437.50	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,425,140.62	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,582,437.50	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,421,152.33	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	996,230.47	
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,159,843.75	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,556,722.67	
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,493,378.91	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,794,343.75	

T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,305,771.88
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,487,881.26
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,681,378.92
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,955,781.24
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,163,861.70
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,752,832.05
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	5,118,742.99
T 2.875% 05/15/52	1,800,000.00	1,677,515.63
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,777,771.08
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,397,935.14
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,868,243.76
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,059,039.07
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,733,579.10
T 2.875% 10/31/23	7,900,000.00	7,867,134.73
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,240,429.70
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,000,371.10
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,410,937.50
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,204,878.12
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,820,703.15
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,104,304.89
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,238,886.73
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,376,572.24
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,638,891.81
T 2% 08/15/51	17,350,000.00	13,184,644.61
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,741,735.98
T 2% 11/15/41	8,200,000.00	6,480,562.50
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,001,683.59
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,885,937.50
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,641,375.81
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	3,878,015.62
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,407,875.00
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,673,164.06
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,941,569.54
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,305,382.83
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	805,612.50
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,440,312.51
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,037,031.26
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,097,187.50
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,112,031.25
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,563,167.97
T 3% 02/15/47	800,000.00	734,000.00
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,117,988.30
T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,698,046.90

T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,511,789.07	
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,287,304.70	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,948,184.37	
T 3% 08/15/48	7,250,000.00	6,748,164.06	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,168,335.94	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,959,960.95	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,563,750.00	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,029,937.50	
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,658,070.31	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,164,765.63	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,193,312.50	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,235,187.50	
T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,429,437.50	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,280,750.00	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	649,000.00	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,003,210.94	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,645,650.00	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	903,750.00	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,360,390.62	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,456,253.90	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,293,687.50	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,852,269.52	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,656,964.85	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,282,804.68	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,699,790.03	
アメリカドル 小計	1,273,310,000.00	1,171,672,061.36 (160,718,256,656)	
カナダドル			
CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,056,696.80	
CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,282,184.00	
CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,318,220.80	
CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,283,385.60	
CAN 0.5% 12/01/30	4,940,000.00	4,055,789.40	
CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,250,600.00	
CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	663,005.00	
CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,367,654.40	
CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,752,447.20	
CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,197,328.80	
CAN 1.5% 04/01/25	2,710,000.00	2,586,884.70	
CAN 1.5% 05/01/24	1,590,000.00	1,539,517.50	
CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,281,473.60	
CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,527,900.80	
CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,156,260.00	

	CAN 1.5% 12/01/31	4,320,000.00	3,816,504.00
	CAN 1.75% 12/01/53	2,260,000.00	1,714,775.00
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	737,270.10
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,407,707.10
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,259,497.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,246,208.00
	CAN 2.25% 06/01/29	760,000.00	727,745.60
	CAN 2.25% 12/01/29	510,000.00	487,192.80
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,309,451.50
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	829,306.80
	CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,592,976.00
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	724,599.20
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,241,369.10
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,187,677.20
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,404,709.20
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,844,820.10
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,144,741.50
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,202,187.00
	CAN 5.75% 06/01/29	1,020,000.00	1,194,705.60
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,201,478.40
	CAN 5% 06/01/37	880,000.00	1,090,390.40
	カナダドル 小計	68,410,000.00	63,684,660.20 (6,717,457,957)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,342,243.00
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,993,646.40
	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,951,500.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	52,610,000.00	47,526,821.80
	MBONO 5% 03/06/25	5,200,000.00	4,713,124.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,899,909.40
	MBONO 7.75% 05/29/31	42,690,000.00	39,831,904.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	25,179,374.90
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	8,122,353.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,340,000.00	36,683,562.80
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	25,416,776.70
	MBONO 8% 07/31/53	3,700,000.00	3,347,390.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,595,151.40
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	25,644,348.00
	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,457,204.40
	メキシコペソ 小計	388,130,000.00	366,705,310.30 (2,491,689,242)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,225,492.40
	BGB 0.2% 10/22/23	630,000.00	625,860.90
	BGB 0.35% 06/22/32	1,330,000.00	1,152,697.70

BGB 0.4% 06/22/40	1,010,000.00	731,724.80
BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,408,597.40
BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	331,411.20
BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,665,206.40
BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,654,746.60
BGB 0.8% 06/22/28	1,460,000.00	1,416,419.00
BGB 0.9% 06/22/29	2,430,000.00	2,343,297.60
BGB 0% 10/22/27	780,000.00	729,838.20
BGB 0% 10/22/31	1,830,000.00	1,566,297.00
BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,421,295.00
BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	816,480.00
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	726,480.00
BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	1,061,464.80
BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,119,001.00
BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,008,850.50
BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,268,736.80
BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,961,469.90
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	826,346.40
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	741,017.20
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,209,378.80
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,488,636.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,136,491.70
BGB 4.25% 03/28/41	2,030,000.00	2,605,099.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,276,971.00
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,300,147.20
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,416,508.80
BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	3,035,967.50
BKO 0.2% 06/14/24	500,000.00	495,495.00
BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,833,609.00
BKO 0% 09/15/23	2,470,000.00	2,455,278.80
BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,867,535.60
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,462,389.60
BTPS 0.3% 08/15/23	1,270,000.00	1,259,611.40
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	558,482.00
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,766,600.10
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,797,596.50
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	1,993,905.60
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,505,627.20
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	665,973.30
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,098,102.50
BTPS 0.9% 04/01/31	3,830,000.00	3,160,018.10
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	726,168.60
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	2,041,734.00

BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,885,977.90	
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,191,956.20	
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,738,450.40	
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	980,210.00	
BTPS 0% 01/30/24	1,630,000.00	1,597,220.70	
BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,546,297.80	
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,923,860.00	
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,347,361.40	
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,449,645.00	
BTPS 0% 11/29/23	1,750,000.00	1,720,197.50	
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,773,589.00	
BTPS 1.1% 04/01/27	1,000,000.00	935,570.00	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,857,511.50	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,713,563.20	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,332,630.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,260,049.00	
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,377,704.00	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	846,650.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,374,356.10	
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,756,391.70	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,820,574.00	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,257,552.00	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,122,374.40	
BTPS 1.75% 05/30/24	800,000.00	799,408.00	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	1,001,370.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,708,876.40	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,459,285.50	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,678,967.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,668,102.40	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,167,136.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	504,707.40	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	740,285.40	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,241,399.60	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,850,000.00	2,461,146.00	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,402,056.80	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,433,664.80	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	2,950,652.70	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	2,974,544.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,990,592.00	
BTPS 2.65% 12/01/27	960,000.00	953,635.20	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	1,884,400.70	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	924,328.70	

BTPS 2.8% 06/15/29	820,000.00	808,462.60
BTPS 2.8% 12/01/28	2,720,000.00	2,716,028.80
BTPS 2.95% 09/01/38	1,580,000.00	1,461,705.40
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,180,922.60
BTPS 2% 12/01/25	1,490,000.00	1,481,253.70
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,322,843.60
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	917,587.20
BTPS 3.25% 09/01/46	1,970,000.00	1,855,405.10
BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,791,353.20
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,050,230.80
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,095,788.40
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,234,323.00
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	1,908,899.40
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,174,361.70
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,875,565.00
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,241,636.80
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,772,640.00
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,906,781.20
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,450,490.00
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,749,226.00
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,537,570.00
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,097,702.40
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,746,054.80
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,935,341.80
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,410,451.00
BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,641,296.00
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,291,092.00
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,566,631.60
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,677,270.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	872,592.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,782,830.50
DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,933,700.00
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,513,832.90
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,059,733.60
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,966,460.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,583,915.20
DBR 0.5% 08/15/27	2,930,000.00	2,868,264.90
DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,286,454.30
DBR 0% 02/15/31	3,280,000.00	2,991,983.20
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	3,279,982.20
DBR 0% 05/15/35	2,780,000.00	2,350,184.20
DBR 0% 05/15/36	3,130,000.00	2,603,095.80
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,204,275.00

DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,259,620.00	
DBR 0% 08/15/30	3,830,000.00	3,518,582.70	
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	615,937.70	
DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,954,893.70	
DBR 0% 08/15/50	5,330,000.00	3,620,082.70	
DBR 0% 08/15/52	1,790,000.00	1,180,057.50	
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,813,835.20	
DBR 0% 11/15/28	1,720,000.00	1,616,163.60	
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,475,141.80	
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,325,014.10	
DBR 1.7% 08/15/32	350,000.00	365,533.00	
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,679,551.50	
DBR 1% 05/15/38	800,000.00	755,200.00	
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,010,640.00	
DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,659,619.60	
DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	4,067,011.20	
DBR 2.5% 08/15/46	3,610,000.00	4,439,541.90	
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	2,899,468.00	
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,958,808.60	
DBR 4.0% 01/04/37	3,190,000.00	4,283,276.80	
DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	3,067,319.00	
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,089,427.00	
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,150,478.80	
DBR 4.75% 07/04/40	2,260,000.00	3,448,556.60	
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,842,889.20	
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,928,783.60	
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,479,872.80	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,711,575.00	
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,235,211.60	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,496,965.20	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,506,429.50	
FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,533,119.50	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,950,000.00	5,600,616.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	3,210,000.00	2,430,708.30	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	484,605.00	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,393,405.20	
FRTR 0.75% 02/25/28	2,150,000.00	2,078,577.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,083,310.60	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,980,000.00	2,684,350.80	
FRTR 0.75% 05/25/53	2,660,000.00	1,752,009.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,630,215.50	
FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,798,735.50	

FRTR 0% 02/25/25	2,050,000.00	1,997,356.00	
FRTR 0% 02/25/26	4,460,000.00	4,290,163.20	
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,313,942.40	
FRTR 0% 03/25/24	4,260,000.00	4,211,691.60	
FRTR 0% 03/25/25	5,490,000.00	5,344,734.60	
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,777,438.40	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,735,841.00	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,308,676.80	
FRTR 0% 11/25/31	5,790,000.00	4,976,505.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	4,390,000.00	4,075,149.20	
FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,667,940.90	
FRTR 1.5% 05/25/31	6,170,000.00	6,140,630.80	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	3,031,898.60	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,516,079.40	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,320,000.00	3,170,932.00	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,233,091.20	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,596,711.00	
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,266,272.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,202,746.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	7,180,000.00	7,728,121.20	
FRTR 2.75% 10/25/27	6,580,000.00	7,063,301.00	
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,380,611.60	
FRTR 2% 11/25/32	580,000.00	590,625.60	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,400,000.00	4,004,758.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,600,000.00	6,076,840.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,882,441.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	6,108,554.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,540,000.00	4,651,099.80	
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,326,628.80	
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,864,309.70	
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	4,245,728.20	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,508,719.80	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,960,122.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,191,726.00	
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	884,681.10	
IRISH 0.2% 10/18/30	960,000.00	857,001.60	
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	406,178.70	
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	502,298.40	
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	375,265.00	
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	748,701.80	
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	725,832.00	
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,171,560.00	
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	632,071.30	

IRISH 1.35% 03/18/31	790,000.00	774,342.20
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	667,016.00
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	787,446.00
IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,633,407.20
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,289,303.40
IRISH 2% 02/18/45	1,280,000.00	1,226,752.00
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,009,042.50
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,287,785.60
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,263,361.10
NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,461,167.60
NETHER 0.5% 01/15/40	1,780,000.00	1,455,897.60
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,270,676.80
NETHER 0.5% 07/15/32	900,000.00	816,210.00
NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,530,640.80
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,653,029.00
NETHER 0% 01/15/24	1,630,000.00	1,615,069.20
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,148,421.40
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,751,201.60
NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,278,285.70
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	736,550.40
NETHER 0% 01/15/52	1,610,000.00	975,804.90
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,215,972.00
NETHER 0% 07/15/31	1,770,000.00	1,564,644.60
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,201,598.00
NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,815,292.40
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,035,491.40
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	2,989,755.00
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,810,368.80
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,116,637.70
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,298,964.40
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,978,421.90
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,673,387.50
OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,053,624.00
OBL 0% 10/09/26	3,900,000.00	3,754,569.00
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,411,170.00
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,500,396.40
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,370,476.00
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	473,310.00
RAGB 0.5% 02/20/29	1,810,000.00	1,702,594.60
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,055,098.20
RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	251,565.60
RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,169,198.80

RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	561,654.60
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,049,091.20
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	165,300.30
RAGB 0.9% 02/20/32	880,000.00	811,756.00
RAGB 0% 02/20/30	1,690,000.00	1,505,164.70
RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,425,602.80
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	904,694.70
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,417,147.20
RAGB 0% 10/20/28	200,000.00	182,626.00
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	459,445.80
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,074,622.40
RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	927,154.50
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	208,396.80
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,004,840.10
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,346,305.80
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	439,783.00
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	751,234.50
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,138,676.40
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	995,037.20
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	598,176.60
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,309,634.60
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,555,552.80
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,463,034.80
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	344,590.40
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	271,814.00
RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	471,765.60
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	364,075.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	606,930.40
RFGB 0.5% 04/15/43	440,000.00	323,703.60
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	836,574.60
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	615,862.00
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	710,873.60
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	746,624.00
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	687,695.40
RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	566,317.80
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	412,792.80
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	285,918.00
RFGB 0% 09/15/30	520,000.00	459,680.00
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	516,980.80
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	433,130.60
RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	478,975.00
RFGB 2.625% 07/04/42	680,000.00	737,630.00
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	593,345.50

RFGB 2% 04/15/24	660,000.00	674,553.00	
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	902,467.30	
SPGB 0.1% 04/30/31	2,700,000.00	2,267,919.00	
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,253,268.40	
SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	3,044,190.00	
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,208,966.40	
SPGB 0.6% 10/31/29	2,050,000.00	1,869,702.50	
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,899,700.00	
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,341,399.60	
SPGB 0.8% 07/30/29	740,000.00	685,617.40	
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,131,281.00	
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,213,652.00	
SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,590,283.20	
SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,452,438.00	
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,758,268.60	
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,072,083.30	
SPGB 0% 05/31/25	990,000.00	954,320.40	
SPGB 1.2% 10/31/40	2,810,000.00	2,185,618.00	
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,866,481.50	
SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,222,672.50	
SPGB 1.4% 04/30/28	3,070,000.00	3,015,538.20	
SPGB 1.4% 07/30/28	3,030,000.00	2,967,885.00	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,622,723.10	
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,008,688.00	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	384,047.40	
SPGB 1.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,991,700.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,080,103.50	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,546,005.00	
SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	702,783.00	
SPGB 1.95% 04/30/26	3,600,000.00	3,666,132.00	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,740,000.00	2,725,971.20	
SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	652,138.60	
SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	1,579,145.10	
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,887,190.70	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,150,000.00	2,146,474.00	
SPGB 2.55% 10/31/32	1,350,000.00	1,370,290.50	
SPGB 2.7% 10/31/48	2,160,000.00	2,100,103.20	
SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,159,403.50	
SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,231,746.00	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,901,556.20	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,637,028.80	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,028,637.70	

	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,801,312.20	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,122,693.60	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,240,000.00	2,905,168.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,840,000.00	1,941,163.20	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,030,000.00	2,667,947.80	
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	4,170,445.30	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,426,795.40	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,760,728.40	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,414,011.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,319,031.00	
	ユーロ 小計	779,510,000.00	776,944,271.30 (106,868,684,517)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,411,548.00	
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,185,193.00	
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,015,987.80	
	UKT 0.25% 01/31/25	1,800,000.00	1,703,574.00	
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,709,031.50	
	UKT 0.375% 10/22/26	2,970,000.00	2,738,399.40	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,841,066.50	
	UKT 0.5% 01/31/29	1,650,000.00	1,470,760.50	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	667,172.60	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,625,302.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	2,810,000.00	2,174,265.60	
	UKT 0.625% 10/22/50	880,000.00	522,341.60	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	788,474.70	
	UKT 0.875% 07/31/33	1,260,000.00	1,061,008.20	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,543,685.00	
	UKT 1.125% 01/31/39	1,370,000.00	1,071,531.80	
	UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	317,064.80	
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	905,350.00	
	UKT 1.25% 07/31/51	1,710,000.00	1,210,851.00	
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,162,748.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,551,280.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,832,555.10	
	UKT 1.5% 07/31/53	420,000.00	316,003.80	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	1,033,127.80	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,740,000.00	1,349,944.20	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	1,107,987.20	
UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,060,085.00		
UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	1,777,503.00		
UKT 1.75% 09/07/37	2,190,000.00	1,921,462.20		
UKT 1% 01/31/32	1,720,000.00	1,509,712.80		
UKT 1% 04/22/24	800,000.00	780,656.00		

	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,490,825.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	2,000,000.00	1,982,060.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,700,393.50	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,765,546.40	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,230,000.00	2,389,355.80	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,549,479.90	
	UKT 3.5% 07/22/68	2,130,000.00	2,672,468.40	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	1,941,664.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	1,932,034.80	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,435,370.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	1,944,064.80	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,499,643.10	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,115,312.50	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	2,408,179.20	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,940,334.90	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,581,403.20	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,570,000.00	1,876,416.90	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,050,000.00	2,587,243.50	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,728,581.60	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,087,893.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,052,820.00	
	UKT 5% 03/07/25	2,300,000.00	2,445,314.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,520,950.00	
	イギリスポンド 小計	95,890,000.00	94,013,028.10 (15,237,631,594)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,700,393.50	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	6,090,367.40	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	7,094,984.40	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,453,875.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,640,000.00	9,317,542.00	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,620,968.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,428,433.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,803,649.90	
	スウェーデンクローナ 小計	62,510,000.00	62,510,213.20 (809,507,260)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,340,000.00	3,735,438.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,727,088.80	
	NGB 1.5% 02/19/26	6,470,000.00	6,098,686.70	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,981,783.60	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,070,000.00	5,836,851.30	
	NGB 1.75% 09/06/29	6,010,000.00	5,515,677.50	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,220,000.00	2,970,256.80	

	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,733,709.40
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,721,820.80
ノルウェークローネ 小計		49,600,000.00	46,321,312.90 (646,182,314)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,880,000.00	3,893,324.40
	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,482,459.50
	DGB 0.5% 11/15/29	8,280,000.00	7,756,124.40
	DGB 0% 11/15/24	2,870,000.00	2,806,429.50
	DGB 0% 11/15/31	8,390,000.00	7,283,694.60
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,616,666.50
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,617,665.40
	DGB 4.5% 11/15/39	13,320,000.00	18,769,611.60
デンマーククローネ 小計		60,650,000.00	62,225,975.90 (1,151,180,554)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,290,000.00	1,790,184.60
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,073,668.40
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,902,290.40
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,924,131.50
	POLGB 1.75% 04/25/32	1,610,000.00	1,121,526.00
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,587,972.10
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,324,859.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,650,000.00	6,637,522.50
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,260,000.00	3,590,498.40
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,846,330.00
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	5,066,625.40
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,493,877.50
	POLGB 3.75% 05/25/27	530,000.00	473,989.60
	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,341,628.30
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	591,324.00
ポーランドズロチ 小計		53,580,000.00	45,766,427.70 (1,325,867,140)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,224,131.40
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,910,895.00
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,660,000.00	2,384,291.00
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,242,662.60
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,721,133.80
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,258,751.20
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,400,000.00	2,045,856.00
	ACGB 1% 11/21/31	3,610,000.00	2,914,389.10
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,948,675.60
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,399,902.40
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,620,000.00	3,403,017.20
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,376,412.00

	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,396,714.40	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,095,096.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,881,827.20	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,607,461.00	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,354,572.90	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,566,988.80	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,189,154.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,048,476.80	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,632,263.40	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,454,443.20	
	ACGB 3% 11/21/33	1,290,000.00	1,228,479.90	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,130,000.00	2,205,828.00	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,517,414.90	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,470,405.60	
	オーストラリアドル 小計	56,000,000.00	51,479,243.40	(4,858,096,199)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	702,360.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	501,978.90	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	594,087.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	647,052.30	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	254,736.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,062,968.40	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	833,111.20	
	SIGB 2.375% 06/01/25	940,000.00	935,140.20	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	403,107.80	
	SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	609,365.60	
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	733,954.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	614,388.60	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	657,416.50	
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,070,000.00	1,082,091.00	
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	673,791.60	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	878,389.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	767,550.20	
SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,601,813.70		
	シンガポールドル 小計	13,960,000.00	13,553,302.80	(1,334,051,594)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,510,000.00	1,363,333.70	
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,926,508.80	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,497,210.30	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,595,058.20	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,830,000.00	1,697,764.20	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	938,686.20	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,714,422.00	

	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,631,823.80
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,387,768.90
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,497,600.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,138,339.40
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,989,581.80
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,138,698.40
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	606,846.00
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,163,804.80
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,298,483.20
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,164,780.80
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,300,172.80
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,534,770.20
	MGS 4.254% 05/31/35	2,760,000.00	2,777,139.60
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,568,775.00
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,965,133.60
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,851,225.30
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,096,872.00
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,528,233.20
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,415,386.40
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,451,048.60
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,775,037.60
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,100,967.00
	マレーシアリングット 小計	53,680,000.00	54,115,471.80 (1,655,630,390)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	840,000.00	825,854.06
	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,010,000.00	970,041.46
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,059,750.94
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,309,707.77
	ILGOV 1.3% 04/30/32	590,000.00	529,981.71
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,970,000.00	1,645,637.53
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,214,210.70
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,241,675.86
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,551,230.28
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	1,991,998.64
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,704,018.90
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,175,576.04
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,425,583.11
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,899,102.53
	ILGOV 6.25% 10/30/26	2,660,000.00	3,069,071.55
	イスラエルシェケル 小計	31,020,000.00	31,613,441.08 (1,327,024,770)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,374,466.40

	CGB 2.18% 06/25/24	22,500,000.00	22,556,925.00	
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,748,403.00	
	CGB 2.47% 09/02/24	18,980,000.00	19,129,372.60	
	CGB 2.48% 04/15/27	9,000,000.00	9,043,740.00	
	CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,684,128.80	
	CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,515,518.40	
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,472,395.20	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,000,000.00	10,105,900.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,387,425.60	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,812,401.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	21,430,000.00	21,888,173.40	
	CGB 2.89% 11/18/31	9,510,000.00	9,670,243.50	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,790,000.00	6,931,571.50	
	CGB 3.01% 05/13/28	10,930,000.00	11,237,133.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,267,604.70	
	CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	47,961,264.40	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,167,429.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	19,110,000.00	19,953,897.60	
	CGB 3.39% 03/16/50	10,420,000.00	10,837,946.20	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	8,017,019.50	
	CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,639,659.40	
	CGB 3.81% 09/14/50	7,460,000.00	8,345,427.40	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,475,223.80	
	CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,766,654.70	
	オフショア人民元 小計	391,470,000.00	400,989,924.10 (8,042,735,105)	
	合計		313,183,995,292 (313,183,995,292)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 221銘柄	100.0%	51.3%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 353銘柄	100.0%	34.1%
イギリスポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	4.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%

ノルウェークローネ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券	26銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券	18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券	25銘柄	100.0%	2.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 8月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,397,860,097
コール・ローン	27,020,046
株式	107,349,392,492
投資信託受益証券	258,972,831
投資証券	107,725,604
派生商品評価勘定	17,200,432
未収入金	723,985
未収配当金	501,906,818
前払金	58,701,902
差入委託証拠金	603,615,634
流動資産合計	114,323,119,841
資産合計	114,323,119,841
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	75,902,334
未払金	2,890,213
未払解約金	24,508,991
未払利息	11
流動負債合計	103,301,549
負債合計	103,301,549
純資産の部	
元本等	
元本	31,497,822,404
剰余金	

	2022年 8月22日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	82,721,995,888
元本等合計	114,219,818,292
純資産合計	114,219,818,292
負債純資産合計	114,323,119,841

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 8月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>

2022年 8月22日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2022年 8月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	31,497,822,404口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.6263円 (1万口当たり純資産額) (36,263円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

2022年 8月22日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	27,055,872,743円
期中追加設定元本額	5,373,833,726円
期中一部解約元本額	931,884,065円
期末元本額	31,497,822,404円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,954,105,069円
世界経済インデックスファンド	6,176,430,919円
DC 新興国株式インデックス・オープン	5,510,508,174円
DC 世界経済インデックスファンド	5,495,188,197円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	152,866,194円
分散投資コア戦略ファンドA	234,719,161円
分散投資コア戦略ファンドS	1,319,362,044円
DC 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	765,251,424円
DC 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	624,717,112円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	340,159,266円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	16,454,602円
SMT インデックスバランス・オープン	83,949,439円
SMT 世界経済インデックス・オープン	168,699,387円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	665,493,113円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	113,768,440円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,702,586円
グローバル経済コア	360,466,469円
My SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	53,040,611円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	30,259,496円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	24,643,337円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	9,338,257円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	13,027,679円
10資産分散投資ファンド	4,133円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,124,643,593円

区分	2022年 8月22日現在
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	191,434,934円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	55,788,749円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	8,800,019円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 8月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	19,355,429,016
投資信託受益証券	13,248,167
投資証券	1,584,147
合計	19,343,764,996

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

(2022年 8月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,554,694,512	-	6,495,992,610	58,701,902
合計		6,554,694,512	-	6,495,992,610	58,701,902

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.59	222,482.40	

TATNEFT-SPONSORED ADR	29,910	0.00	-
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	5.34	90,406.20
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	-
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	171	0.00	-
SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	-
SOUTHERN COPPER CORP	11,571	48.40	560,036.40
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	53,727	26.56	1,426,989.12
LI AUTO INC - ADR	67,571	29.94	2,023,075.74
NIO INC - ADR	160,649	19.05	3,060,363.45
XPENG INC - ADR	53,231	21.24	1,130,626.44
H WORLD GROUP LTD-ADR	19,163	38.93	746,015.59
TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	4.40	180,655.20
TRIP.COM GROUP LTD	67,056	26.11	1,750,832.16
YUM CHINA HOLDINGS INC	50,479	47.16	2,380,589.64
AUTOHOME INC-ADR	6,571	34.79	228,605.09
IQIYI INC-ADR	28,984	3.59	104,052.56
JOYY INC	6,185	27.02	167,118.70
KANZHUN LTD	6,900	21.05	145,245.00
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	4.46	506,419.62
VK CO LTD	19,368	0.00	-
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	18.20	95,531.80
YANDEX NV-A	32,725	0.00	-
OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-
PINDUODUO INC-ADR	53,748	45.76	2,459,508.48
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	9.99	527,122.35
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	-
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	68,136	1.46	99,478.56
BEIGENE LTD-ADR	4,929	174.84	861,786.36
HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	13.02	94,303.86
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	3,311	45.43	150,418.73
ZAI LAB LTD-ADR	12,825	42.82	549,166.50
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	189,281	1.84	348,277.04
CREDICORP LTD	8,778	132.37	1,161,943.86
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-
360 DIGITECH INC	8,061	14.46	116,562.06
LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	3.96	451,966.68
KE HOLDINGS INC	35,144	15.38	540,514.72
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.86	132,006.11
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	24,700	3.26	80,571.40
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	63.07	494,153.45
アメリカドル 小計	1,734,111		22,886,825.27 (3,139,385,822)

メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,063,461	8.66	17,869,572.26	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	377,892	79.29	29,963,056.68	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	174.23	2,526,335.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	41.44	4,013,546.88	
	ALFA S.A.B. -A	313,500	14.11	4,423,485.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	78.03	2,926,125.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	440.76	10,271,911.80	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	301.56	13,172,140.80	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	151.53	6,468,058.05	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	288,490	28.41	8,196,000.90	
	WALMART DE MEXICO-SER V	567,680	71.42	40,543,705.60	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	144.07	7,271,933.25	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	242,440	132.23	32,057,841.20	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	231.85	6,018,826.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	73.56	13,373,208.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	30.07	5,466,726.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	324,600	127.11	41,259,906.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	36.12	9,120,300.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,513,640	19.29	67,778,115.60	
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	74,800	21.87	1,635,876.00		
	メキシコペソ 小計	8,717,560		324,356,670.02	(2,203,938,701)
ブラジルリアル	COSAN SA	118,300	20.83	2,464,189.00	
	PETRO RIO SA	84,700	23.97	2,030,259.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	475,700	35.31	16,796,967.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	544,440	31.73	17,275,081.20	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	13.57	1,025,892.00	
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	33.71	650,603.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	15.37	1,527,778.00	
	GERDAU SA-PREF	141,800	23.73	3,364,914.00	
	SUZANO SA	90,079	49.97	4,501,247.63	
	VALE SA	477,787	66.96	31,992,617.52	
	WEG SA	217,544	29.85	6,493,688.40	
	CCR SA	125,600	14.03	1,762,168.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	75,752	62.75	4,753,438.00	
	RUMO SA	159,700	19.33	3,087,001.00	
	AMERICANAS SA	73,040	13.03	951,711.20	
	LOJAS RENNER S.A.	115,947	27.13	3,145,642.11	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	3.78	1,154,790.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	18.68	3,231,640.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	20.20	838,300.00	
	RAIA DROGASIL SA	122,500	22.80	2,793,000.00	

	AMBEV SA	628,600	15.66	9,843,876.00	
	BRF SA	52,500	16.41	861,525.00	
	JBS SA	110,000	32.37	3,560,700.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	14.47	1,451,456.76	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	510,254	7.66	3,908,545.64	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,600	34.83	1,588,248.00	
	HYPERA SA	54,500	41.77	2,276,465.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	261,323	16.21	4,236,045.83	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	584,982	19.61	11,471,497.02	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	41.05	3,624,715.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	575,881	26.64	15,341,469.84	
	ITAUSA SA	528,325	9.40	4,966,255.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	715,509	12.51	8,951,017.59	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	28.50	1,966,500.00	
	TOTVS SA	57,900	30.80	1,783,320.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	44.37	2,320,551.00	
	TIM SA	96,100	12.26	1,178,186.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	50.04	1,851,480.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	105,500	48.17	5,081,935.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	12.82	2,715,622.14	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	46.57	2,351,785.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	36.19	984,368.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	41.80	1,933,250.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	24.96	4,120,896.00	
	ブラジルリアル 小計	8,711,948		208,210,636.88 (5,524,244,617)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	7,621.00	340,887,330.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,723.80	234,376,467.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	18,037	85,000.00	1,533,145,000.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	89.00	219,045,732.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,010.00	142,382,370.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,196.00	165,033,648.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	5,038.80	37,211,538.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	85.49	415,707,093.60	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,718	27,180.00	155,415,240.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	35.15	220,735,708.15	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	98.90	345,291,053.50	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	27.49	70,409,532.22	
	チリペソ 小計	20,076,902		3,879,640,712.47 (564,266,584)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,267.00	1,108,515,393.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	38,000.00	1,116,288,000.00	

	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	33,980.00	2,091,978,700.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	20,650.00	1,043,052,150.00
	コロンビアесо 小計	630,431		5,359,834,243.00 (167,714,573)
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	9,898	16.10	159,357.80
	OPAP SA	18,496	13.74	254,135.04
	JUMBO SA	19,341	15.24	294,756.84
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	0.99	261,453.18
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	0.99	279,947.25
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	3.45	254,058.00
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	17.09	447,877.63
	PUBLIC POWER CORP	20,834	5.95	123,962.30
	ユーロ 小計	714,859		2,075,548.04 (285,491,632)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	326.90	3,793,020.70
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	29.72	3,469,958.60
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	25.54	2,542,915.64
	KOC HOLDING AS	89,884	46.44	4,174,212.96
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	25.72	7,683,798.56
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	68.50	5,933,127.50
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	334.80	2,176,534.80
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	106.40	4,556,473.60
	AKBANK T.A.S.	276,321	10.60	2,929,002.60
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	24.60	5,199,751.20
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	6.99	2,687,396.37
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	18.71	2,677,232.61
	トルコリラ 小計	1,767,743		47,823,425.14 (362,740,679)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	22,644	615.00	13,926,060.00
	CEZ AS	13,098	1,039.00	13,608,822.00
	チェココルナ 小計	35,742		27,534,882.00 (153,820,864)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,834.00	126,178,182.00
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	7,970.00	120,968,660.00
	OTP BANK NYRT	38,695	9,148.00	353,981,860.00
	ハンガリーフォリント 小計	98,396		601,128,702.00 (204,553,276)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	68.30	2,097,697.90
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	200,051	6.25	1,250,318.75
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	101.70	2,052,916.20
	LPP SA	124	9,680.00	1,200,320.00
	CD PROJEKT SA	6,704	88.93	596,186.72

	CYFROWY POLSAT SA	36,098	20.30	732,789.40
	ALLEGRO.EU SA	39,203	27.20	1,066,321.60
	DINO POLSKA SA	5,945	354.00	2,104,530.00
	BANK PEKAO SA	27,684	72.00	1,993,248.00
	M BANK SA	1,423	243.80	346,927.40
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	24.73	3,222,244.81
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	241.00	1,769,663.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	48,568	30.25	1,469,182.00
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.26	348,530.39
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	8.96	569,178.14
	ポーランドズロチ 小計	673,493		20,820,054.31 (603,163,219)
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	1,310,610	0.00	0.13
	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	-
	NOVATEK PJSC	105,900	0.00	0.01
	ROSNEFT OIL CO PJSC	134,073	0.00	0.01
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,232,060	0.00	0.12
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	7,220	0.00	-
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	195,980	0.00	0.01
	PHOSAGRO PJSC	8,882	0.00	-
	POLYUS PJSC	3,969	0.00	-
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	-
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11
	VTB BANK PJSC	756,074,000	0.00	75.60
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	-
	ロシアルーブル 小計	760,345,896		75.99 (175)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	6.61	2,174,690.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	116,000	7.43	861,880.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,915,400	3.65	10,641,210.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	460,000	23.50	10,810,000.00
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	236,000	3.72	877,920.00
	PETROCHINA CO LTD-H	2,648,000	3.43	9,082,640.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	142,000	28.60	4,061,200.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.81	955,400.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	30.95	4,472,275.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	7.70	1,686,300.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	7.96	3,279,520.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	5.13	1,477,440.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	3.63	2,940,300.00
	DONGYUE GROUP	147,000	8.44	1,240,680.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	54,040	70.10	3,788,204.00

JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	67,000	9.73	651,910.00
MMG LIMITED	304,000	2.21	671,840.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	6.88	887,520.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	4,750	13.26	62,985.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	7.19	1,301,390.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	9.04	6,590,160.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	4.01	1,102,750.00
BOC AVIATION LTD	23,800	67.75	1,612,450.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.28	642,880.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	16.90	4,106,700.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	9.34	1,195,520.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	4.42	3,120,520.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	8.70	1,479,000.00
CITIC LTD	617,000	8.43	5,201,310.00
CRRC CORP LTD-H	409,000	2.88	1,177,920.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	5.97	1,719,360.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	17.92	1,397,760.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	8.35	1,336,000.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	8.49	462,705.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	10.80	2,287,440.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	14.72	2,078,699.52
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	39.30	2,448,390.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	3.66	425,292.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	3.86	1,486,385.64
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	6.30	1,348,200.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.76	1,180,480.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	12.20	2,019,673.40
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.23	744,480.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	11.60	6,009,380.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	5.01	1,256,377.74
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	6.89	2,218,580.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	235.00	4,112,500.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	6.95	989,589.65
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	6.14	1,903,400.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	5.47	2,014,800.00
BYD CO LTD-H	102,000	279.40	28,498,800.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	5.03	1,337,980.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	36.65	2,140,360.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	758,000	17.42	13,204,360.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	10.96	3,866,140.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	6.88	2,465,406.72
MINTH GROUP LTD	64,000	20.50	1,312,000.00

YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	16.14	1,743,120.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	151,600	85.45	12,954,220.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	4.50	1,971,000.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	303,000	23.85	7,226,550.00
LI NING CO LTD	292,000	69.10	20,177,200.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	99,600	84.10	8,376,360.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	12.86	2,121,900.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	16.68	1,934,880.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	17.62	1,004,340.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	19.32	4,723,740.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	68,400	15.92	1,088,928.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.62	899,000.00
BAIDU INC-CLASS A	267,900	127.70	34,210,830.00
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	180.70	4,806,620.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	31.55	1,627,980.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	24.50	2,254,000.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	211,600	74.00	15,658,400.00
NETEASE INC	246,830	133.00	32,828,390.00
TENCENT HOLDINGS LTD	748,300	315.00	235,714,500.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,830,888	89.50	163,864,476.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	4.34	1,831,480.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	16.48	1,713,920.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	268,000	2.12	568,160.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	123,550	59.55	7,357,402.50
JD.COM INC - CL A	237,411	217.20	51,565,669.20
MEITUAN-CLASS B	495,300	169.90	84,151,470.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	19.76	1,061,112.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	18.70	1,208,020.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	6.31	719,340.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	40.75	3,749,000.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	120.35	1,829,320.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	6.65	3,750,600.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	402,000	33.30	13,386,600.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	182,000	58.10	10,574,200.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.53	868,380.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	193,000	45.80	8,839,400.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	16.30	3,178,500.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	12.34	2,813,520.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	68,000	76.40	5,195,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.78	542,400.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	6.22	3,483,200.00

YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	22.00	1,056,000.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	38.80	3,395,000.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	20.40	510,000.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	35,200	41.45	1,459,040.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	5.54	686,960.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	17.48	1,153,680.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	9.70	3,872,240.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	10.90	1,399,560.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	17.04	3,258,048.00
3SBIO INC	119,000	5.07	603,330.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	60.10	601,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	12.04	2,973,880.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,144,160	7.96	9,107,513.60
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.31	1,608,660.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	26.95	3,557,400.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	74.50	379,950.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	15.50	1,891,000.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	139,000	33.10	4,600,900.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	55.00	1,839,750.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	26.65	1,945,450.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	4.18	4,652,340.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	42,288	89.85	3,799,576.80
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	423,000	68.20	28,848,600.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,441,000	2.55	8,774,550.00
BANK OF CHINA LTD-H	9,806,200	2.75	26,967,050.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.59	5,042,000.25
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.30	3,138,960.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	11,210,620	4.91	55,044,144.20
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.37	888,750.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	455,923	40.45	18,442,085.35
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.53	1,706,232.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,699,515	4.05	27,133,035.75
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	4.81	5,093,790.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.08	898,560.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.15	2,004,450.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	203,600	14.16	2,882,976.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	16.26	4,646,701.50
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.01	1,442,400.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	10.24	907,264.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.30	1,893,160.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	10.52	1,426,512.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	918,000	11.30	10,373,400.00

CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	16.24	6,278,384.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.04	1,479,552.96
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	18.14	1,748,696.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.31	2,169,090.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	7.76	5,348,874.88
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	784,500	43.55	34,164,975.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	20.65	943,705.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	104,500	7.33	765,985.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	1.63	942,140.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	468,540	19.80	9,277,092.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	7.72	1,737,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	367,111	30.65	11,251,952.15
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	67,600	33.15	2,240,940.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	14.72	2,626,048.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	64,000	4.95	316,800.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	586,560	2.17	1,272,835.20
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,016,654	2.49	2,531,468.46
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	232,000	15.38	3,568,160.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	15.14	1,097,650.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	6.82	1,227,600.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	72,600	10.24	743,424.00
LONGFOR PROPERTIES	229,000	25.00	5,725,000.00
SEAZEN GROUP LTD	768,000	2.89	2,219,520.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00
WHARF HOLDINGS	154,000	29.15	4,489,100.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	9.39	1,085,484.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	7.26	2,003,760.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	27.10	3,433,570.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	16.02	4,982,220.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	88,000	6.18	543,840.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	13.16	1,039,640.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	14.68	1,049,620.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	21.40	1,294,700.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	22.30	1,494,100.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.18	495,420.00
LENOVO GROUP LTD	900,000	7.19	6,471,000.00
SUNNY OPTICAL TECH	92,900	117.20	10,887,880.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,906,200	11.66	22,226,292.00
ZTE CORP-H	82,908	17.02	1,411,094.16
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.01	4,611,660.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	24.40	1,451,800.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.35	1,433,500.00

	CGN POWER CO LTD-H	791,000	1.92	1,518,720.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	11.48	5,354,272.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	13.84	6,255,680.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	4.67	3,110,220.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	32.45	3,439,700.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	16.40	4,221,360.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	98,600	120.70	11,901,020.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	7.76	3,460,960.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.28	3,013,120.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	5.78	3,167,440.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	24.80	1,587,200.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	23.90	2,151,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	625,987	11.74	7,349,087.38	
	香港ドル 小計	100,322,189		1,431,095,283.01 (25,015,545,547)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.32	959,709.76	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	22.66	568,766.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	8.74	2,358,926.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	4.85	1,399,710.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.49	286,118.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.36	793,776.56	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	6.20	660,882.80	
	MISC BHD	125,040	6.90	862,776.00	
	GENTING BHD	271,600	4.72	1,281,952.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.98	1,101,706.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	2.09	634,210.50	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	4.23	1,143,538.20	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	50,646	22.80	1,154,728.80	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	135.00	972,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	16.86	1,238,872.80	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.10	636,480.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.61	1,138,882.06	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	181,300	1.81	328,153.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.41	1,469,813.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	0.87	439,263.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	4.05	1,217,835.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	923,175	5.42	5,003,608.50	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	20.86	1,278,551.12	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	19.62	326,339.46	
	MALAYAN BANKING BHD	571,105	8.92	5,094,256.60	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,675,000	4.61	7,721,750.00	

	RHB BANK BHD	214,897	5.88	1,263,594.36
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.00	855,867.00
	DIGI.COM BERHAD	311,700	3.66	1,140,822.00
	MAXIS BHD	267,900	3.84	1,028,736.00
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.77	1,566,855.04
	PETRONAS GAS BHD	75,500	17.20	1,298,600.00
	TENAGA NATIONAL BHD	305,275	8.70	2,655,892.50
	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.86	785,642.00
	マレーシアリングット 小計	9,791,928		50,668,614.06 (1,550,175,845)
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	157.50	31,626,000.00
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	37.00	44,303,800.00
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	57.50	6,905,750.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	43.75	9,030,000.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	46.75	22,726,764.50
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	58.00	5,834,800.00
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	102,600	363.00	37,243,800.00
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	527,000	72.00	37,944,000.00
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.95	7,312,150.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	8.40	6,799,800.00
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	5.50	4,456,650.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.50	12,151,723.00
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	39.75	7,242,450.00
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	14.00	11,761,890.00
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	26.50	7,658,500.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	33.75	5,994,000.00
	CP ALL PCL-NVDR	691,700	61.00	42,193,700.00
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	107.50	4,977,250.00
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	26.00	14,466,400.00
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	31.75	2,095,500.00
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	17.90	3,309,710.00
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	27.25	32,070,525.00
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	194.50	16,085,150.00
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	16.20	7,106,130.00
	SCB X PCL-NVDR	88,700	105.00	9,313,500.00
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	18.60	3,070,860.00
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	72,600	74.00	5,372,400.00
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	59.50	6,039,250.00
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	44.00	3,951,200.00
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	51.25	3,910,375.00
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	65.25	14,766,075.00
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	9.00	7,848,000.00

	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	564.00	21,939,600.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	196.00	23,461,200.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	75.00	9,138,750.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	4.86	4,672,447.74	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	37.25	1,989,150.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	184.50	3,118,050.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	83.25	18,306,675.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	68.75	4,688,750.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	49.25	19,842,825.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	81,450	42.25	3,441,262.50	
	タイパーツ 小計	14,249,966		546,166,812.74 (2,091,818,892)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	60.40	14,371,576.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	770.00	21,775,600.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	529.00	3,627,882.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	56.80	17,239,538.40	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	883.00	32,039,655.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	187.00	28,635,310.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	228.00	13,910,280.00	
	MONDE NISSIN CORP	490,500	16.30	7,995,150.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	127.00	12,136,120.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	95.80	20,358,937.00	
	BDO UNIBANK INC	219,911	129.30	28,434,492.30	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	53.50	8,628,854.50	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.78	8,904,546.00	
	AYALA LAND INC	794,100	29.55	23,465,655.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,567,750	37.95	59,496,112.50	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	320,000	19.54	6,252,800.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,360.00	11,068,400.00	
	PLDT INC	10,460	1,750.00	18,305,000.00	
	ACEN CORP	821,840	8.68	7,133,571.20	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	326.00	17,336,680.00	
	フィリピンペソ 小計	7,934,509		361,116,159.90 (885,492,935)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	3,250.00	7,027,475,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	31,650.00	6,358,485,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	964,000	1,760.00	1,696,640,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,060.00	2,030,748,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	910.00	2,623,075,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,000.00	1,953,600,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	4,310.00	6,996,410,070.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	6,500.00	1,977,300,000.00	

	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	6,575.00	2,272,320,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,542,000	6,975.00	17,730,450,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,090.00	4,469,883,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	5,900.00	4,674,570,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	25,200.00	1,501,920,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,700.00	1,400,700,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,575.00	2,821,332,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	4,730.00	3,530,472,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,610.00	6,743,485,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	6,769,300	7,900.00	53,477,470,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	474,900	9,550.00	4,535,295,000.00	
	BANK MANDIRI	2,163,796	8,500.00	18,392,266,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,500.00	6,886,700,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	8,237,202	4,300.00	35,419,968,600.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,195.00	3,394,517,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,601,300	4,600.00	25,765,980,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	2,950.00	3,174,495,000.00	
	インドネシアルピア 小計	48,743,795		226,855,557,170.00 (2,109,756,681)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	59,200.00	306,656,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	94,000.00	600,378,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,766	204,500.00	1,383,647,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	46,600.00	576,954,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	32,900.00	368,118,100.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	587,000.00	706,748,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	130,500.00	247,689,000.00	
	LG CHEM LTD	5,774	640,000.00	3,695,360,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	308,500.00	270,554,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	183,000.00	353,190,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	157,000.00	525,950,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	9,290	255,000.00	2,368,950,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,122	99,000.00	111,078,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	89,700.00	209,718,600.00	
	SKC CO LTD	1,734	128,000.00	221,952,000.00	
	CJ CORP	1,230	81,000.00	99,630,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	33,400.00	143,887,200.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	42,494	21,150.00	898,748,100.00	
	ECOPRO BM CO LTD	4,680	114,000.00	533,520,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	30,950.00	209,222,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	44,350.00	292,399,550.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	46,050.00	449,816,400.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	138,500.00	292,927,500.00	

KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,828	56,300.00	328,116,400.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	92,000.00	400,568,000.00
LG CORP	11,686	83,800.00	979,286,800.00
LG ENERGY SOLUTION	2,553	447,000.00	1,141,191,000.00
SAMSUNG C&T CORP	11,910	120,000.00	1,429,200,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	22,450.00	415,684,200.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	6,010.00	571,965,690.00
SK INC	4,545	231,500.00	1,052,167,500.00
S-1 CORPORATION	3,573	60,100.00	214,737,300.00
CJ LOGISTICS	862	124,500.00	107,319,000.00
HMM CO LTD	35,545	23,250.00	826,421,250.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	178,000.00	497,154,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	23,739	26,200.00	621,961,800.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,520.00	164,142,720.00
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	39,100.00	276,280,600.00
HANON SYSTEMS	19,000	10,500.00	199,500,000.00
HYUNDAI MOBIS	7,116	214,500.00	1,526,382,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	16,824	190,000.00	3,196,560,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	90,600.00	276,420,600.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	89,600.00	309,030,400.00
KIA CORP	29,259	77,200.00	2,258,794,800.00
COWAY CO LTD	9,036	65,900.00	595,472,400.00
F&F CO LTD / NEW	3,017	151,500.00	457,075,500.00
HLB INC	10,012	46,350.00	464,056,200.00
LG ELECTRONICS INC	13,527	101,000.00	1,366,227,000.00
KANGWON LAND INC	7,703	26,550.00	204,514,650.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	9,880	22,450.00	221,806,000.00
CJ ENM CO LTD	830	98,800.00	82,004,000.00
HYBE CO LTD	2,474	186,500.00	461,401,000.00
KAKAO CORP	37,877	76,700.00	2,905,165,900.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	55,400.00	167,363,400.00
KRAFTON INC	3,554	255,000.00	906,270,000.00
NAVER CORP	15,839	248,000.00	3,928,072,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,939	374,500.00	726,155,500.00
NETMARBLE CORP	2,465	66,800.00	164,662,000.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	57,800.00	266,169,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	71,900.00	313,699,700.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	100,000.00	103,400,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	171,500.00	279,888,000.00
EMART	3,594	104,000.00	373,776,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	416,000.00	322,400,000.00
KT&G CORP	18,829	81,600.00	1,536,446,400.00

ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	110,000.00	345,620,000.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	127,000.00	477,774,000.00
LG H&H CO LTD	956	714,000.00	682,584,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	389	357,500.00	139,067,500.00
PACIFIC CORP	3,393	35,550.00	120,621,150.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,851	74,500.00	659,399,500.00
SD BIOSENSOR INC	3,909	36,600.00	143,069,400.00
ALTEOGEN INC	2,841	68,000.00	193,188,000.00
CELLTRION INC	10,890	201,500.00	2,194,335,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,968	82,000.00	161,376,000.00
GREEN CROSS CORP	564	166,500.00	93,906,000.00
HANMI PHARM CO LTD	1,156	310,500.00	358,938,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,993	868,000.00	1,729,924,000.00
SEEGENE INC	3,838	33,250.00	127,613,500.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	76,900.00	245,849,300.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	116,500.00	244,650,000.00
YUHAN CORPORATION	12,567	57,300.00	720,089,100.00
HANA FINANCIAL GROUP	33,962	38,500.00	1,307,537,000.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	9,770.00	276,784,100.00
KAKAOBANK CORP	18,421	28,650.00	527,761,650.00
KB FINANCIAL GROUP INC	48,657	50,800.00	2,471,775,600.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	50,883	35,700.00	1,816,523,100.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	12,450.00	739,604,700.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	60,800.00	279,801,600.00
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	7,939	31,300.00	248,490,700.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,920.00	235,687,680.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,650.00	206,249,750.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,990.00	120,948,930.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	35,000.00	202,160,000.00
DB INSURANCE CO LTD	4,209	63,800.00	268,534,200.00
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	7,329	39,200.00	287,296,800.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	201,000.00	624,708,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	62,200.00	461,337,400.00
SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	133,500.00	497,287,500.00
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,166	74,000.00	160,284,000.00
L&F CO LTD	3,026	243,300.00	736,225,800.00
LG DISPLAY CO LTD	24,071	16,900.00	406,799,900.00
LG INNOTEK CO LTD	1,415	338,500.00	478,977,500.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,845	136,500.00	934,342,500.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	573,964	60,900.00	34,954,407,600.00
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	96,421	55,800.00	5,380,291,800.00
SAMSUNG SDI CO LTD	6,526	618,000.00	4,033,068,000.00

	LG UPLUS CORP	22,125	12,350.00	273,243,750.00
	SK TELECOM	9,599	51,000.00	489,549,000.00
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	21,500.00	568,868,500.00
	SK HYNIX INC	65,667	96,400.00	6,330,298,800.00
	SK SQUARE CO LTD	11,660	42,950.00	500,797,000.00
	韓国ウォン 小計	1,932,198		121,963,650,570.00 (12,513,470,548)
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	85.70	9,618,968.00
	ASIA CEMENT CORP	234,176	42.60	9,975,897.60
	CHINA STEEL	1,494,261	29.20	43,632,421.20
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	70.30	29,530,288.30
	FORMOSA PLASTICS CORP	441,824	94.30	41,664,003.20
	NAN YA PLASTICS CORP	647,752	71.00	45,990,392.00
	TAIWAN CEMENT	648,419	39.45	25,580,129.55
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	841.00	15,606,437.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	30.90	10,754,065.20
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,795.00	16,155,000.00
	WALSIN LIHWA CORP	309,213	37.35	11,549,105.55
	CHINA AIRLINES LTD	183,000	21.40	3,916,200.00
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	31.70	12,236,200.00
	EVERGREEN MARINE	308,039	98.00	30,187,822.00
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	29.20	13,782,400.00
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	100.50	7,500,817.50
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	86.40	18,748,800.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	35.35	6,259,106.35
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	456.00	9,091,272.00
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	176.00	12,398,848.00
	GIANT MANUFACTURING	34,464	252.50	8,702,160.00
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	295.00	9,145,000.00
	POU CHEN	273,780	29.00	7,939,620.00
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	42,000	605.00	25,410,000.00
	MOMO.COM INC	6,000	742.00	4,452,000.00
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	277.50	24,570,960.00
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	645,395	65.80	42,466,991.00
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	593,540	17.70	10,505,658.00
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,011,237	24.60	49,476,430.20
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,491,629	28.05	41,840,193.45
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,273,202	26.80	34,121,813.60
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,095,361	23.35	25,576,679.35
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,241,622	35.80	44,450,067.60
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,168,457	17.30	20,214,306.10
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,284,432	17.50	22,477,560.00

TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,110,787	27.60	30,657,721.20
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	451,861	51.00	23,044,911.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	151,375	219.00	33,151,125.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,389,633	20.80	28,904,366.40
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	47.50	42,185,842.50
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,896,226	13.90	26,357,541.40
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	909,435	60.00	54,566,100.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,262,866	9.02	11,391,051.32
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	206,724	63.00	13,023,612.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	283.00	13,584,000.00
ACER INC	255,803	22.15	5,666,036.45
ADVANTECH CO LTD	43,336	347.00	15,037,592.00
ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	264.50	19,068,334.00
AUO CORP	945,090	16.95	16,019,275.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	178.00	21,128,600.00
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,049,000	12.45	13,060,050.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	22.90	9,887,304.00
DELTA ELECTRONICS INC	217,903	272.50	59,378,567.50
E INK HOLDINGS INC	94,000	241.50	22,701,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,510,248	111.00	167,637,528.00
INVENTEC CO LTD	280,511	24.05	6,746,289.55
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,060.00	30,982,400.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	67.70	15,263,100.40
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	115.50	6,930,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	295.00	6,195,000.00
PEGATRON CORP	200,474	63.00	12,629,862.00
QUANTA COMPUTER INC	286,270	79.80	22,844,346.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	56.30	11,378,230.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	141,000	163.50	23,053,500.00
WIWYNN CORP	8,000	760.00	6,080,000.00
WPG HOLDINGS LTD	260,692	49.90	13,008,530.80
YAGEO CORPORATION	54,764	332.00	18,181,648.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	116.00	15,998,952.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	505,315	121.50	61,395,772.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	74.20	16,027,200.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	100.00	24,520,000.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	359,315	90.00	32,338,350.00
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,000.00	3,000,000.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,455.00	8,730,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	514.00	12,336,000.00
MEDIATEK INC	179,804	693.00	124,604,172.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	54.30	6,244,500.00

	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	74,045	270.00	19,992,150.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	950.00	7,600,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	301,000	35.70	10,745,700.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	364.50	22,578,588.00	
	SILERGY CORP	36,000	656.00	23,616,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,954,389	519.00	1,533,327,891.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,411,000	43.00	60,673,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	75.00	6,675,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	174.00	5,568,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	22.75	7,939,750.00	
	新台湾ドル 小計	39,788,513		3,549,182,103.27 (16,212,308,929)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	338.25	32,546,753.25	
	COAL INDIA LTD	180,326	217.15	39,157,790.90	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	263.70	15,670,372.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	290,647	72.15	20,970,181.05	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	381,562	134.60	51,358,245.20	
	PETRONET LNG LTD	83,779	212.95	17,840,738.05	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	367,287	2,613.85	960,033,124.95	
	ACC LTD	5,315	2,350.85	12,494,767.75	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	420.45	30,916,949.85	
	ASIAN PAINTS LTD	42,204	3,482.55	146,977,540.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	697.10	20,528,897.90	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,605.85	50,630,844.65	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	427.35	77,137,102.35	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	403.95	28,185,207.30	
	JSW STEEL LTD	99,332	664.55	66,011,080.60	
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,320.65	42,494,358.05	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,720.80	49,515,839.20	
	SHREE CEMENT LTD	1,387	21,423.20	29,713,978.40	
	SRF LTD	14,609	2,455.10	35,866,555.90	
	TATA STEEL LTD	940,850	110.05	103,540,542.50	
	ULTRATECH CEMENT LTD	11,556	6,647.55	76,819,087.80	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	768.25	53,509,380.75	
	VEDANTA LTD	107,173	262.00	28,079,326.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	34,272	3,130.20	107,278,214.40	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	169,135	285.10	48,220,388.50	
	HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,350.00	48,149,100.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	82,638	1,936.05	159,991,299.90	
	SIEMENS INDIA LTD	11,025	2,850.25	31,424,006.25	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	735.15	16,903,303.95	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	64,743	871.80	56,442,947.40	

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	683.45	18,080,669.75
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,970.30	16,471,708.00
BAJAJ AUTO LTD	9,644	4,074.55	39,294,960.20
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,168.85	19,153,114.35
BHARAT FORGE LTD	30,322	736.00	22,316,992.00
EICHER MOTORS LTD	14,685	3,424.10	50,282,908.50
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,838.65	34,739,398.70
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	101,669	1,239.40	126,008,558.60
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	15,707	8,778.95	137,890,967.65
MRF LTD	432	86,825.90	37,508,788.80
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	124,426	128.15	15,945,191.90
TATA MOTORS LTD	190,082	471.00	89,528,622.00
PAGE INDUSTRIES LTD	886	50,031.95	44,328,307.70
TITAN INDUSTRIES LTD	46,501	2,440.60	113,490,340.60
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	596.60	26,208,638.00
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	4,454.45	34,989,704.75
TRENT LTD	19,255	1,398.15	26,921,378.25
ZOMATO LTD	170,264	61.45	10,462,722.80
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	4,382.00	76,790,168.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,474	3,662.55	42,024,098.70
ITC LTD	345,135	312.00	107,682,120.00
MARICO LTD	81,711	515.95	42,158,790.45
NESTLE INDIA LIMITED	3,906	19,440.90	75,936,155.40
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	786.95	48,014,180.35
UNITED SPIRITS LTD	32,483	792.00	25,726,536.00
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,567.20	14,991,835.20
DABUR INDIA LTD	58,111	587.20	34,122,779.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	905.90	57,430,436.40
HINDUSTAN UNILEVER LTD	97,997	2,634.55	258,177,996.35
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	13,485	4,135.35	55,765,194.75
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	569.30	20,161,759.50
BIOCON LTD	58,256	308.15	17,951,586.40
CIPLA LTD	49,816	1,030.10	51,315,461.60
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	3,696.20	54,637,228.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,204.00	53,155,376.00
LUPIN LTD	26,552	688.95	18,293,000.40
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	110,469	901.35	99,571,233.15
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,542.75	18,852,405.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	638.95	19,254,119.30
AXIS BANK LTD	273,120	757.50	206,888,400.00
BANDHAN BANK LTD	74,811	281.80	21,081,739.80
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	214,032	2,468.05	528,241,677.60

	ICICI BANK LTD	618,625	870.40	538,451,200.00
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	73,561	1,877.00	138,073,997.00
	STATE BANK OF INDIA	226,932	520.35	118,084,066.20
	YES BANK LTD	1,020,164	16.55	16,883,714.20
	BAJAJ FINANCE LTD	32,202	7,301.70	235,129,343.40
	BAJAJ FINSERV LTD	5,500	16,287.60	89,581,800.00
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	777.80	29,978,745.40
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,044.05	12,970,233.15
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	1,945.90	22,809,839.80
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	921.00	28,562,973.00
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,346.85	28,574,769.60
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	129,053	576.65	74,418,412.45
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,289.30	30,350,122.00
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	576.50	18,293,498.00
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,296.95	69,737,001.50
	DLF LTD	56,420	373.70	21,084,154.00
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,364.60	17,363,170.40
	HCL TECHNOLOGIES LTD	123,161	970.05	119,472,328.05
	INFOSYS LTD	396,083	1,597.10	632,584,159.30
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	4,892.70	28,162,381.20
	MINDTREE LTD	6,247	3,520.70	21,993,812.90
	MPHASIS LTD	7,796	2,394.15	18,664,793.40
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	106,835	3,385.75	361,716,601.25
	TATA ELXSI LTD	4,179	10,138.75	42,369,836.25
	TECH MAHINDRA LTD	72,109	1,104.15	79,619,152.35
	WIPRO LTD	179,580	432.45	77,659,371.00
	BHARTI AIRTEL LTD	294,891	732.30	215,948,679.30
	INDUS TOWERS LTD	90,578	196.70	17,816,692.60
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	2,411.35	102,675,283.00
	ADANI POWER LTD	85,623	411.95	35,272,394.85
	ADANI TOTAL GAS LTD	33,068	3,390.90	112,130,281.20
	ADANI TRANSMISSION LTD	32,827	3,635.25	119,334,351.75
	GAIL INDIA LTD	174,768	133.15	23,270,359.20
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	418.10	11,173,304.40
	NTPC LTD	664,141	157.75	104,768,242.75
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	327,337	228.15	74,681,936.55
	TATA POWER CO LTD	199,512	232.65	46,416,466.80
	インドルピー 小計	11,400,107		9,006,332,644.20 (15,580,955,474)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	18.74	1,122,788.36
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.00	1,878,920.00
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.62	1,163,083.50

	INDUSTRIES QATAR	196,788	18.12	3,565,798.56	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	7.61	1,553,791.83	
	MASRAF AL RAYAN	732,376	4.77	3,493,433.52	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	12.49	1,231,001.91	
	QATAR ISLAMIC BANK	185,298	27.06	5,014,163.88	
	QATAR NATIONAL BANK	530,405	22.31	11,833,335.55	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.80	788,462.00	
	OORED00 QSC	72,800	9.12	663,936.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	20.00	1,930,240.00	
	カタールリアル 小計	3,297,787		34,238,955.11 (1,277,797,804)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	213.59	4,810,046.80	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	231.55	3,396,838.50	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	5,906	1,168.06	6,898,562.36	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	51,324	251.70	12,918,250.80	
	GOLD FIELDS LTD	97,102	147.62	14,334,197.24	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	53.92	3,035,749.92	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	114,090	177.64	20,266,947.60	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	415.58	2,232,495.76	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	32,710	168.65	5,516,541.50	
	SASOL LTD	72,299	331.36	23,956,996.64	
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	38.29	15,121,639.96	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	225.95	6,259,266.90	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	120.20	4,871,585.80	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	192.59	5,490,740.90	
	NASPERS LTD-N SHS	27,673	2,473.40	68,446,398.20	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	144,533	20.55	2,970,153.15	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	132.47	4,974,778.38	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	53.19	5,877,229.05	
	BID CORP LTD	35,017	323.00	11,310,491.00	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	301.75	10,688,588.50	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	60,003	233.92	14,035,901.76	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	153.41	3,570,464.34	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	147.43	8,282,912.26	
	ABSA GROUP LTD	95,814	184.82	17,708,343.48	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9,724	2,105.00	20,469,020.00	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	215.95	13,628,820.45	
	STANDARD BANK GROUP LTD	173,745	164.54	28,588,002.30	
FIRSTRAND LTD	617,542	67.85	41,900,224.70		
REINET INVESTMENTS SCA	17,187	289.47	4,975,120.89		
REMGRO LTD	55,441	135.08	7,488,970.28		
DISCOVERY LIMITED	59,544	132.59	7,894,938.96		

	OLD MUTUAL LTD	489,612	11.27	5,517,927.24
	SANLAM LTD	214,053	56.89	12,177,475.17
	NEPI ROCKCASTLE SA	60,556	93.63	5,669,858.28
	MTN GROUP LTD	194,516	138.47	26,934,630.52
	VODACOM GROUP	62,331	133.29	8,308,098.99
	南アフリカランド 小計	3,607,288		460,528,208.58 (3,707,252,079)
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	4.61	2,046,941.42
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	9.45	3,090,509.10
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	9.13	1,696,180.53
	DUBAI ISLAMIC BANK	335,455	5.90	1,979,184.50
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	13.65	3,689,049.00
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	492,228	19.74	9,716,580.72
	ALDAR PROPERTIES PJSC	487,034	4.82	2,347,503.88
	EMAAR PROPERTIES PJSC	576,832	5.91	3,409,077.12
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	404,510	26.90	10,881,319.00
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	3,523,160		38,856,345.27 (1,453,615,876)
クウェートディ ナール	AGILITY	157,695	0.84	133,725.36
	BOUBYAN BANK K.S.C	152,875	0.83	127,803.50
	GULF BANK	137,143	0.35	48,000.05
	KUWAIT FINANCE HOUSE	632,130	0.89	562,595.70
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	838,738	1.06	896,610.92
	MABANEE CO KPSC	133,798	0.80	108,242.58
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.62	184,034.60
	クウェートディナール 小計	2,349,209		2,061,012.71 (921,478,782)
オフショア人民 元	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	29.70	594,000.00
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	5.18	518,000.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	21.08	2,027,896.00
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	12.43	989,428.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	14.88	1,306,464.00
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	38.55	1,079,400.00
	YANZHOU COAL MINING CO-A	20,700	44.63	923,841.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	4.49	737,707.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	31.90	939,136.00
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	5.35	207,045.00
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	54.76	1,128,056.00
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	78,847	20.04	1,580,093.88
	CHINA JUSHI CO LTD -A	300	14.80	4,440.00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	31.33	651,664.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	11,200	89.09	997,808.00

GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	51.75	1,284,745.50
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	19.99	741,629.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	12,900	130.15	1,678,935.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	17.47	174,700.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	2.13	981,930.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.37	262,200.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	22.65	505,095.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	108.25	844,350.00
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	10.99	334,096.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	18.31	280,143.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	13.55	1,073,160.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	6.53	1,437,253.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	15.19	735,955.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	39,625	24.85	984,681.25
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	17.92	129,955.84
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	27.89	500,346.60
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.66	1,048,956.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	11,200	66.40	743,680.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	5.01	688,374.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	18.66	919,938.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	47.96	517,968.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	4,200	356.30	1,496,460.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	15.23	149,254.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.05	1,011,380.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	5.67	522,774.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	84.88	1,485,400.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	72.84	671,584.80
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	11,775	108.05	1,272,288.75
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	11.04	1,228,752.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	11,400	151.81	1,730,634.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	197.90	811,390.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	79.27	587,390.70
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	105,600	8.84	933,504.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	49.68	566,352.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	48.42	750,510.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	27.07	227,388.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	16.39	1,048,960.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	26.27	1,450,498.05
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.28	1,375,068.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	4.95	1,043,955.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	17,700	532.00	9,416,400.00
CRRC CORP LTD-A	185,800	4.98	925,284.00

EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	110.80	839,088.40
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	7.12	162,336.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	10,200	283.98	2,896,596.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	41.40	240,120.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	88.12	555,156.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	41.55	1,093,596.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	50.07	573,601.92
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	17.12	823,472.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.19	1,055,571.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	29.83	1,079,846.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	69,984	28.65	2,005,041.60
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	109.40	1,277,245.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	7.36	1,201,152.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	16.26	681,294.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	62.40	1,771,723.20
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	17,900	10.17	182,043.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	138.37	1,383,700.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	32.24	1,312,168.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	522.98	1,338,828.80
TBEA CO LTD-A	22,519	25.96	584,593.24
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	11.64	502,848.00
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	5,320	169.31	900,729.20
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	5.37	1,070,778.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	15.09	303,474.99
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	36.25	1,145,500.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	40.95	338,247.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	12.45	1,122,990.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.02	482,202.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	5.58	449,748.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	43.75	481,250.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	10.04	260,036.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	338,800	4.57	1,548,316.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.81	192,400.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	6.26	1,004,730.00
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	49.88	1,012,564.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	56.44	300,204.36
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.25	233,100.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	21.21	1,181,397.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	18.87	412,120.80
BYD CO LTD -A	9,700	319.39	3,098,083.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	16.42	711,839.84
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	38.99	721,315.00

HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	20.22	693,546.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	158.40	1,330,560.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	18.00	527,400.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	82.31	57,617.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	16.27	693,102.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	24.93	978,602.22
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	1,443	343.00	494,949.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	89.36	250,208.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	30.46	1,325,010.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	26.16	726,201.60
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	43.72	346,787.04
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	116.11	894,047.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	24.31	632,060.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	4.53	462,060.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	44.91	359,280.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	56.30	1,475,060.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	5.43	430,599.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	12.48	417,830.40
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	19.94	488,530.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	9.51	509,736.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.93	826,642.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	298.94	866,926.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	29.54	481,502.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	14.94	340,632.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	4.70	289,050.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	188.00	2,293,600.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	8.15	900,575.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	18,576	30.71	570,468.96
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	50.17	508,723.80
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	47.81	511,567.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	248.28	397,248.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	51.61	113,542.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	53.85	985,455.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	143.65	430,950.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	7.46	443,870.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	23.72	244,316.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	47.50	475,000.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	110.50	872,950.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	30.19	138,874.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	20,248	78.17	1,582,786.16
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	19.23	526,902.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	62.90	1,069,300.00

HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	26.21	31,452.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	35.78	1,227,325.56
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	45.41	785,593.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	170.85	1,554,735.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	5.87	162,599.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	147.00	823,200.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	37.56	431,940.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	47.10	329,700.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	8,500	1,895.01	16,107,585.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	216.30	2,119,740.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	58.28	1,955,760.24
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	15.45	414,060.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	265.04	2,486,075.20
TONGWEI CO LTD-A	31,600	59.96	1,894,736.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	24.34	928,814.40
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	30,200	173.66	5,244,532.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	45.89	463,489.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	15.25	80,825.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	17.05	506,385.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	70,574	28.37	2,002,184.38
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	67.47	191,479.86
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	40.58	394,437.60
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	9,450	22.77	215,176.50
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	44.40	548,340.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	11.42	118,768.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	17.49	258,852.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	4.81	119,480.40
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	43.31	312,221.79
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	289.50	2,431,800.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	124.65	249,300.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	7.89	298,478.70
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	171.76	48,092.80
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	28,080	20.60	578,448.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	7,491	133.12	997,201.92
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	47.85	770,385.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	60.68	333,740.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	193.60	425,920.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	40.35	411,570.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	93.12	921,888.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	36.50	810,044.50
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	27.76	444,160.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	103.50	828,000.00

HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	19.63	370,025.50
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	544.50	1,132,560.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	35.90	1,367,861.80
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	11,116	80.09	890,280.44
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	18.02	498,829.64
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	5.69	364,729.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	35.23	383,302.40
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	25.15	176,050.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	21.52	203,148.80
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	21.90	245,980.80
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	44.62	758,540.00
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	90.41	1,488,510.24
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	54.01	536,859.40
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	293.40	1,144,260.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	19.96	180,039.20
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	21.47	748,186.56
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	44.93	435,821.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	2.83	1,000,688.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.12	238,960.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.57	451,973.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	13.29	1,497,783.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	6.91	1,587,503.40
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	10.36	1,528,100.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	28.71	1,673,793.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	5.86	266,630.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	5.47	683,203.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	2.84	366,076.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	137,700	33.85	4,661,145.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.63	993,168.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	3.24	999,864.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.10	608,940.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.33	1,130,996.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	17.80	1,694,560.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	12.57	1,500,858.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.52	639,580.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	7.20	995,760.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.28	401,800.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	12.67	1,005,998.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.51	430,548.30
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.54	110,246.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	9.22	430,574.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.37	383,184.20

CITIC SECURITIES CO-A	49,680	19.98	992,606.40
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	26.57	640,337.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	97,856	22.90	2,240,902.40
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	16.20	58,320.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	6.34	381,668.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	6.87	568,836.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	16.34	990,204.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	171,679	6.49	1,114,196.71
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.56	1,052,688.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.62	1,158,621.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	85.31	460,674.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	13.12	413,280.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	6.31	554,649.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	8.61	367,647.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	8.93	362,343.68
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.19	868,168.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.89	443,460.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	11.11	485,507.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	19.89	361,998.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	40.97	2,736,796.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	14.91	815,577.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	17.01	913,437.00
GEMDALE CORP-A	45,500	11.53	524,615.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	566,400	2.56	1,449,984.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	16.81	1,375,058.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	21.51	275,328.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	12.18	103,530.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	7.49	201,481.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	170.12	820,488.76
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	26,460	12.91	341,598.60
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	9.88	284,544.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.08	338,656.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	31.22	517,065.64
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	38.94	420,552.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	14.89	494,348.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	98.65	295,950.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	7,943	38.01	301,913.43
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	128.32	705,760.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	20.39	268,536.30
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	33.32	1,262,828.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.95	452,670.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	28.65	802,200.00

CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	9.89	344,172.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	121.35	1,104,285.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	14.66	304,928.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	9.52	429,352.00
GOERTEK INC -A	26,900	36.50	981,850.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	5.76	288,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	69.95	489,650.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	23.81	469,342.72
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	12.52	210,336.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	37.40	1,737,230.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	100.25	173,232.00
NINESTAR CORP-A	18,543	49.85	924,368.55
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	6.42	200,946.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	17.00	413,100.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	94.17	448,249.20
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	77.41	498,133.35
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	29.78	848,730.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	10.24	481,280.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	18.38	337,089.20
WESTONE INFORMATION INDUST-A	20,100	35.50	713,550.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	68.71	288,582.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	41,316	14.63	604,453.08
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	190.30	894,410.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	72.66	817,425.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	14.41	436,623.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	33.45	291,015.00
ZTE CORP-A	12,600	24.68	310,968.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	6.63	1,152,294.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	6.38	1,539,494.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	23.59	4,243,369.20
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	18.61	1,034,716.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	4.00	1,262,800.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	10.74	726,024.00
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	92,300	13.09	1,208,207.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	136.80	970,869.60
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	91.35	926,106.30
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	4.31	355,575.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	119.30	748,249.60
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	15,120	70.17	1,060,970.40
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	43.19	323,925.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	86.51	648,825.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	24,430	69.07	1,687,380.10

	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	27.14	808,772.00
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	47,040	56.12	2,639,884.80
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	54.98	1,157,603.90
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	306.62	950,522.00
	SG MICRO CORP-A	3,150	170.34	536,571.00
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	415.60	1,163,680.00
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	29,500	53.78	1,586,510.00
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	10.11	331,102.50
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	20.18	453,363.88
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	72.19	1,834,925.42
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	227.65	1,115,485.00
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	105.45	768,730.50
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	64.58	917,036.00
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	82.06	1,396,825.32
	オフショア人民元 小計	16,828,015		290,028,980.47 (5,817,169,267)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	18.20	817,889.80
	SAUDI ARABIAN OIL CO	288,739	39.20	11,318,568.80
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	52.90	622,897.50
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	16.66	531,920.48
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	28,237	163.00	4,602,631.00
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	49.25	1,589,937.75
	SAUDI ARABIAN MINING CO	95,014	70.90	6,736,492.60
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	106,249	103.80	11,028,646.20
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,414	27.10	1,041,019.40
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	16.04	1,659,033.24
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	51.70	1,372,945.20
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	217.60	915,443.20
	JARIR MARKETING CO	12,500	182.80	2,285,000.00
	ALMARAI CO	30,130	54.10	1,630,033.00
	SAVOLA	25,336	33.30	843,688.80
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	212.40	2,488,690.80
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	238.80	1,901,325.60
	AL RAJHI BANK	237,965	91.00	21,654,815.00
	ALINMA BANK	109,956	39.10	4,299,279.60
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	31.60	2,718,579.60
	BANK AL-JAZIRA	35,813	24.72	885,297.36
	BANK ALBILAD	61,145	54.00	3,301,830.00
	BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	52.10	3,518,625.60
	RIYAD BANK	166,012	36.65	6,084,339.80
	SAUDI BRITISH BANK	116,762	42.00	4,904,004.00
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	41,945	20.50	859,872.50

THE SAUDI NATIONAL BANK	265,761	71.70	19,055,063.70
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	3,929	224.60	882,453.40
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	158.40	960,379.20
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	14.38	1,452,250.58
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	10.58	488,658.46
ELM CO	2,436	328.60	800,469.60
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	37.40	1,287,083.60
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	12.38	1,120,489.04
SAUDI TELECOM CO	66,310	106.00	7,028,860.00
ACWA POWER CO	9,184	174.80	1,605,363.20
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	26.50	2,443,856.50
サウジアラビアリアル 小計	2,540,586		136,737,734.11 (5,003,233,691)
合計	1,069,816,331		107,349,392,492 (107,349,392,492)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	7,376,504.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	7,376,504.00 (50,121,869)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	3,397,960.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,377,459.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,759,670.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,336,574.00	
	ブラジルリアル 小計	279,400	7,871,663.00 (208,850,962)		
投資信託受益証券合計			337,800	258,972,831 (258,972,831)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	8,225,700.00	
		メキシコペソ 小計	391,700	8,225,700.00 (55,891,986)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	6,438,958.85	
		南アフリカランド 小計	478,733	6,438,958.85 (51,833,618)	
投資証券合計			870,433	107,725,604 (107,725,604)	
合計				366,698,435 (366,698,435)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 41銘柄	100.0%			2.9%
メキシコペソ	株式 20銘柄	95.4%			2.0%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.2%		0.0%
	投資証券 1銘柄			2.4%	0.1%
ブラジルレアル	株式 44銘柄	96.4%			5.1%
	投資信託受 益証券 4銘柄		3.6%		0.2%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%			0.5%
コロンビアペソ	株式 4銘柄	100.0%			0.2%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 12銘柄	100.0%			0.3%
チェココルナ	株式 2銘柄	100.0%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.0%			0.6%
ロシアルーブル	株式 13銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式 197銘柄	100.0%			23.2%
マレーシアリンギット	株式 34銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式 42銘柄	100.0%			1.9%
フィリピンペソ	株式 20銘柄	100.0%			0.8%
インドネシアルピア	株式 25銘柄	100.0%			2.0%
韓国ウォン	株式 112銘柄	100.0%			11.6%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%			15.1%
インドルピー	株式 109銘柄	100.0%			14.5%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.0%			1.2%
南アフリカランド	株式 36銘柄	98.6%			3.4%
	投資証券 1銘柄			1.4%	0.0%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 9銘柄	100.0%			1.3%
クウェートディナール	株式 7銘柄	100.0%			0.9%
オフショア人民元	株式 323銘柄	100.0%			5.4%

サウジアラビアリアル	株式	37銘柄	100.0%			4.6%
------------	----	------	--------	--	--	------

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 8月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	379,318,323
コール・ローン	1,264,251,820
国債証券	82,772,476,563
未収利息	1,141,809,529
前払費用	112,053,864
流動資産合計	85,669,910,099
資産合計	85,669,910,099
負債の部	
流動負債	
未払解約金	22,017,558
未払利息	531
流動負債合計	22,018,089
負債合計	22,018,089
純資産の部	
元本等	
元本	47,678,167,518
剰余金	
剰余金又は欠損金()	37,969,724,492
元本等合計	85,647,892,010
純資産合計	85,647,892,010
負債純資産合計	85,669,910,099

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 8月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

2022年 8月22日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2022年 8月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,678,167,518口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7964円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (17,964円)</p>

(金融商品に関する注記)

1.金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

2022年 8月22日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	42,682,968,944円
期中追加設定元本額	10,135,174,014円
期中一部解約元本額	5,139,975,440円
期末元本額	47,678,167,518円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国債券インデックス・オープン	5,275,424,252円
世界経済インデックスファンド	12,829,447,968円
D C 新興国債券インデックス・オープン	5,145,393,894円
D C 世界経済インデックスファンド	11,155,222,708円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	4,009,600円
コア投資戦略ファンド（安定型）	104,373,835円
コア投資戦略ファンド（成長型）	273,391,462円
新興国債券インデックス・オープン（S M A 専用）	55,051,349円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	474,198,229円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,558,834,243円
コア投資戦略ファンド（切替型）	125,149,470円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	208,623,771円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	93,806,473円
S M T インデックスバランス・オープン	169,537,991円
外国債券S M T B セレクション（S M A 専用）	3,080,750,418円
S M T 世界経済インデックス・オープン	350,576,349円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	437,052,932円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	697,798,817円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	9,613,942円
グローバル経済コア	751,274,431円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	33,693,326円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	5,548,851円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	31,783,594円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	23,934,732円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	8,634,564円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	11,526,505円
M y S M T 新興国債券インデックス（ノーロード）	1,605,338円
10資産分散投資ファンド	13,984円

区分	2022年 8月22日現在
F O F s用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	58,043,749円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	478,967,457円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	115,485,058円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	14,700,942円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 01（適格機関投資家専用）	282,637,302円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 08（適格機関投資家専用）	277,843,492円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 11（適格機関投資家専用）	276,426,997円
S M T A M海外バランスファンド2021 - 04（適格機関投資家専用）	273,775,150円
S M T A M海外バランスファンド2021 - 07（適格機関投資家専用）	269,515,561円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 8月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,582,925,466
合計	4,582,925,466

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	34,746,588.00	
		MBONO 10% 12/05/24	104,250,000.00	105,729,307.50	
		MBONO 5.5% 03/04/27	17,000,000.00	14,894,040.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	198,300,000.00	179,140,254.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	54,100,000.00	53,268,483.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000.00	108,110,760.00	

	MBONO 7.75% 05/29/31	140,600,000.00	131,186,830.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	74,367,605.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	34,600,000.00	31,755,188.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	115,100,000.00	113,076,542.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	93,680,883.00	
	MBONO 8% 07/31/53	6,500,000.00	5,880,550.00	
	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	125,141,208.00	
	MBONO 8% 11/07/47	100,600,000.00	90,838,782.00	
	MBONO 8% 12/07/23	88,000,000.00	86,144,960.00	
	メキシコペソ 小計	1,316,050,000.00	1,247,961,980.50	(8,479,652,065)
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	138,400,000.00	117,063,231.84	
	BLTN 0% 07/01/23	53,300,000.00	47,763,350.56	
	BLTN 0% 07/01/24	30,850,000.00	24,771,914.49	
	BLTN 0% 07/01/25	38,900,000.00	28,112,983.32	
	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	30,437,268.90	
	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000.00	38,597,656.42	
	BNTNF 10% 01/01/29	31,700,000.00	28,922,034.56	
	BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	12,365,080.85	
	BNTNF 10% 01/01/33	1,500,000.00	1,315,040.42	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,295,875.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,796,687.50	
	ブラジルレアル 小計	384,800,000.00	332,441,123.86	(8,820,327,898)
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	805,000,000.00	622,859,928.00	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,855,000,000.00	2,510,493,408.16	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,920,000,000.00	1,742,127,254.40	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,170,000,000.00	1,905,313,210.57	
	BTPCL 4% 03/01/23	1,010,000,000.00	978,812,722.07	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	1,892,786,288.64	
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	598,059,632.94	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,730,000,000.00	1,594,094,755.15	
	チリペソ 小計	13,360,000,000.00	11,844,547,199.93	(1,722,706,478)
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	60,463,229,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	15,900,000,000.00	13,797,702,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	37,100,000,000.00	26,060,895,000.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	20,900,000,000.00	12,884,014,000.00	
	コロンビアペソ 小計	139,200,000,000.00	113,205,840,000.00	(3,542,323,939)
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,363,525.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	5,114,798.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,653,528.00	

	PERUGB 5.94% 02/12/29	9,500,000.00	8,680,055.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,800,000.00	6,894,264.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,350,000.00	7,877,390.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,750,000.00	7,000,110.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	9,150,000.00	8,695,245.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,050,000.00	6,316,502.50	
	ペルーソル 小計	63,150,000.00	57,595,417.50 (2,044,297,508)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	21,470,500.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	15,427,840.00	
	ウルグアイペソ 小計	42,000,000.00	36,898,340.00 (125,026,335)	
ドミニカペ ソ	DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	32,553,180.00	
	ドミニカペソ 小計	33,000,000.00	32,553,180.00 (83,173,374)	
チェココ ルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	19,282,419.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	57,147,436.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	43,920,090.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	64,900,000.00	50,792,687.00	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	21,286,560.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	57,000,000.00	44,621,880.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	52,826,085.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	15,213,313.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	47,000,000.00	37,899,390.00	
	CZGB 1% 06/26/26	54,800,000.00	47,674,356.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	62,700,000.00	58,102,836.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	63,300,000.00	56,957,340.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	80,500,000.00	72,893,555.00	
	CZGB 2% 10/13/33	64,500,000.00	52,066,980.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	20,694,520.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	34,635,240.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	45,080,220.00	
CZGB 6% 02/26/26	39,500,000.00	40,961,105.00		
	チェココルナ 小計	883,400,000.00	772,056,012.00 (4,313,013,705)	
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	455,982,450.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	222,500,000.00	205,102,725.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	374,952,720.00	
	HGB 1% 11/26/25	635,000,000.00	478,294,700.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	712,000,000.00	419,154,400.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	143,672,320.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	466,216,480.00	

	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	355,269,845.00	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	268,466,510.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	559,159,440.00	
	HGB 3% 04/25/41	321,000,000.00	167,436,810.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	353,777,375.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	384,570,600.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	444,929,440.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	207,164,600.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	584,073,600.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	476,000,000.00	451,957,240.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	572,000,000.00	511,877,080.00	
ハンガリーフォリント 小計		9,142,000,000.00	6,832,058,335.00 (2,324,826,474)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	14,462,190.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	12,346,477.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	15,200,000.00	10,710,072.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	12,400,000.00	8,637,840.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	16,387,811.50	
	POLGB 2.5% 04/25/24	19,800,000.00	18,544,284.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	20,910,365.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	14,833,984.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	20,600,000.00	17,362,504.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	21,260,277.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	20,350,000.00	18,625,337.50	
	POLGB 3.75% 05/25/27	12,100,000.00	10,821,272.00	
	POLGB 4% 10/25/23	12,700,000.00	12,339,701.00	
	ポーランドズロチ 小計		231,700,000.00	197,242,115.00 (5,714,163,244)
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,351,100.00	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	1,200,000.00	1,121,748.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	8,000,000.00	6,852,560.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	12,600,000.00	11,322,990.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	6,000,000.00	4,439,400.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,228,900.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	10,500,000.00	8,902,950.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	6,400,000.00	5,038,400.00	
	ROMGB 4.25% 06/28/23	11,800,000.00	11,502,286.00	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,093,696.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	3,200,000.00	2,995,840.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	3,800,000.00	2,888,646.00	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,283,204.00	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	1,000,000.00	848,300.00	
ROMGB 4% 10/25/23	13,800,000.00	13,280,568.00		

	ROMGB 5.8% 07/26/27	7,600,000.00	7,020,956.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,180,580.00	
	ルーマニアレイ 小計	111,800,000.00	99,352,124.00 (2,800,060,781)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	23,100,000.00	20,856,297.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,167,458.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	14,100,000.00	14,174,730.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	14,650,000.00	14,525,914.50	
	MGS 3.582% 07/15/32	3,500,000.00	3,396,295.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	11,500,000.00	11,420,765.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,887,296.50	
	MGS 3.757% 05/22/40	18,350,000.00	17,024,029.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,166,314.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	7,942,520.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	6,100,000.00	6,179,117.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	20,267,520.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	20,800,000.00	21,006,752.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	14,450,000.00	14,577,449.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	8,799,267.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	23,000,000.00	23,322,920.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000.00	19,832,302.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	12,450,000.00	11,517,744.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,243,416.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	20,174,510.50	
MGS 4.504% 04/30/29	3,200,000.00	3,318,848.00		
MGS 4.696% 10/15/42	3,500,000.00	3,656,240.00		
MGS 4.762% 04/07/37	9,550,000.00	10,117,079.00		
	マレーシアリンギット 小計	281,250,000.00	278,574,784.00 (8,522,828,371)	
タイパーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	89,235,715.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	139,255,038.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000.00	183,322,880.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	50,694,852.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	55,969,725.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	111,100,000.00	105,591,662.00	
	THAIGB 1% 06/17/27	176,000,000.00	167,532,640.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	113,600,000.00	114,628,080.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	123,000,000.00	124,790,880.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	90,100,000.00	81,513,470.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	93,200,000.00	97,311,052.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	65,004,558.00	
	THAIGB 2% 12/17/31	31,000,000.00	29,785,420.00	

	THAIGB 3.3% 06/17/38	122,700,000.00	126,025,170.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	134,879,632.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	99,000,000.00	101,074,050.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000.00	191,700,405.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	198,849,600.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	112,490,258.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	138,614,025.00	
	タイパーツ 小計	2,289,500,000.00	2,308,269,112.00 (8,840,670,698)	
フィリピン ペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	29,127,300.00	
	フィリピンペソ 小計	30,000,000.00	29,127,300.00 (71,423,052)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,786,426,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,508,225,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	26,000,000,000.00	24,728,600,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	36,500,000,000.00	35,776,205,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	50,300,000,000.00	50,889,516,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	34,000,000,000.00	33,051,740,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	16,432,782,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	41,000,000,000.00	39,059,880,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	2,100,000,000.00	1,973,328,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	60,677,500,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	26,300,000,000.00	26,756,305,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,522,000,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	28,300,000,000.00	28,340,752,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	34,929,220,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	20,175,361,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	34,700,000,000.00	35,732,672,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	18,918,880,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	40,800,000,000.00	41,579,688,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	43,000,000,000.00	43,046,440,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	46,800,000,000.00	49,164,336,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,200,000,000.00	33,498,504,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	34,416,186,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,367,212,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	53,600,000,000.00	56,247,840,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	47,908,080,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,273,148,000.00	
INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	43,011,661,000.00		
INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	26,318,139,000.00		
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,178,286,000.00		
INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,847,816,000.00		

インドネシアルピア 小計		896,100,000,000.00	922,116,728,000.00 (8,575,685,570)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	182,400,000.00	192,929,952.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	54,800,000.00	36,536,804.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	46,100,000.00	29,231,088.00	
	SAGB 7% 02/28/31	64,700,000.00	51,889,400.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	129,000,000.00	110,133,750.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	113,700,000.00	91,877,559.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	116,000,000.00	92,283,800.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	143,200,000.00	113,503,184.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	110,000,000.00	94,006,000.00	
	SAGB 8% 01/31/30	155,100,000.00	137,193,705.00	
	SAGB 9% 01/31/40	100,300,000.00	82,789,626.00	
南アフリカランド 小計		1,215,300,000.00	1,032,374,868.00 (8,310,617,687)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,532,952.00	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	3,007,230.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	8,000,000.00	8,045,680.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,343,134.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,134,800.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,200,000.00	7,251,048.00	
	CGB 2.75% 06/15/29	2,000,000.00	2,021,180.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,159,840.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,863,098.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,793,392.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	17,110,067.00	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,134,800.00	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,125,100.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,414,920.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	15,000,000.00	15,421,500.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,726,355.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	12,900,000.00	13,205,343.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	17,500,000.00	17,949,575.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,643,000.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	15,300,000.00	15,808,266.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,587,543.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	5,600,000.00	5,776,904.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,785,180.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,704,893.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	23,019,480.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	15,200,000.00	15,871,232.00	
CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,846,810.00		
CGB 3.29% 10/18/23	10,000,000.00	10,172,100.00		

	CGB 3.53% 10/18/51	6,300,000.00	6,779,493.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,300,000.00	8,062,558.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	17,500,000.00	19,577,075.00	
	オフショア人民元 小計	410,800,000.00	422,874,548.00 (8,481,679,384)	
	合計		82,772,476,563 (82,772,476,563)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.2%
ブラジルレアル	国債証券 11銘柄	100.0%	10.7%
チリペソ	国債証券 8銘柄	100.0%	2.1%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	4.3%
ペルーソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.5%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%
チェココルナ	国債証券 18銘柄	100.0%	5.2%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	2.8%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	6.9%
ルーマニアレイ	国債証券 17銘柄	100.0%	3.4%
マレーシアリンギット	国債証券 23銘柄	100.0%	10.3%
タイバーツ	国債証券 20銘柄	100.0%	10.7%
フィリピンペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアルピア	国債証券 30銘柄	100.0%	10.4%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	10.0%
オフショア人民元	国債証券 31銘柄	100.0%	10.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 8月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,360,407,696
投資証券	116,832,918,200
派生商品評価勘定	84,994,800
未収入金	44,543,865
未収配当金	719,599,106
差入委託証拠金	224,378,000
流動資産合計	121,266,841,667
資産合計	121,266,841,667
負債の部	
流動負債	
前受金	84,994,800
未払解約金	149,373,855
未払利息	1,413
流動負債合計	234,370,068
負債合計	234,370,068
純資産の部	
元本等	
元本	54,578,193,107
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	66,454,278,492
元本等合計	121,032,471,599
純資産合計	121,032,471,599
負債純資産合計	121,266,841,667

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 8月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2022年 8月22日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 8月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	54,578,193,107口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2176円 (1万口当たり純資産額) (22,176円)

(金融商品に関する注記)

1.金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

	2022年 8月22日現在

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	49,268,603,738円
期中追加設定元本額	11,001,871,410円
期中一部解約元本額	5,692,282,041円
期末元本額	54,578,193,107円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,711,655,009円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,312,910円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,513,680,601円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	26,391,134,806円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,231,460,197円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,893,665,668円
分散投資コア戦略ファンドA	795,726,284円
分散投資コア戦略ファンドS	1,687,481,776円
コア投資戦略ファンド（切替型）	841,651,913円
S M T インデックスバランス・オープン	26,509,578円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	232,399,572円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	7,873,238円
グローバル経済コア	246,941,770円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,508,580円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	491,083,733円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	84,708,335円
M y S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	28,576,412円
10資産分散投資ファンド	7,002円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	454,978,589円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	19,130,547円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	413,317,327円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	68,316,579円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	862,012,029円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	260,285,768円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	296,774,884円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 8月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	732,968,196
合計	732,968,196

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

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(2022年 8月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	4,085,127,200	-	4,170,122,000	84,994,800
合計		4,085,127,200	-	4,170,122,000	84,994,800

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,106	254,615,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,319	330,904,300	
	S O S i L A物流リート投資法人	4,843	758,898,100	
	東海道リート投資法人	1,256	156,120,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,577	2,453,822,000	
	森ヒルズリート投資法人	12,182	1,869,937,000	
	産業ファンド投資法人	15,481	2,833,023,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	10,358	3,770,312,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,430	1,643,516,000	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	5,469	2,340,732,000	
	G L P投資法人	31,903	5,541,551,100	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,819	1,624,003,000	
	日本プロロジスリート投資法人	16,975	5,958,225,000	

星野リゾート・リート投資法人	1,812	1,165,116,000	
Oneリート投資法人	1,807	499,635,500	
イオンリート投資法人	11,468	1,778,686,800	
ヒューリックリート投資法人	9,693	1,615,823,100	
日本リート投資法人	3,365	1,253,462,500	
積水ハウス・リート投資法人	31,483	2,641,423,700	
トーセイ・リート投資法人	2,298	318,273,000	
ケネディクス商業リート投資法人	4,354	1,242,631,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,554	461,252,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,693	339,048,700	
野村不動産マスターファンド投資法人	33,501	5,718,620,700	
いちごホテルリート投資法人	1,716	162,676,800	
ラサールロジポート投資法人	12,682	2,200,327,000	
スターアジア不動産投資法人	12,935	733,414,500	
マリモ地方創生リート投資法人	1,294	171,843,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,092	2,230,140,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,672	112,692,800	
投資法人みらい	12,586	643,144,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,431	322,350,600	
三菱地所物流リート投資法人	3,197	1,529,764,500	
CREロジスティクスファンド投資法人	4,012	833,693,600	
ザイマックス・リート投資法人	1,680	215,880,000	
タカラレーベン不動産投資法人	4,085	458,337,000	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	4,039	630,487,900	
日本ビルファンド投資法人	12,085	8,435,330,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,360	6,661,480,000	
日本都市ファンド投資法人	52,270	5,859,467,000	
オリックス不動産投資法人	20,642	4,041,703,600	
日本プライムリアルティ投資法人	7,085	2,876,510,000	
NTT都市開発リート投資法人	9,958	1,476,771,400	
東急リアル・エステート投資法人	6,946	1,357,248,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,097	787,057,300	
ユナイテッド・アーバン投資法人	23,321	3,421,190,700	
森トラスト総合リート投資法人	7,404	1,069,137,600	
インヴィンシブル投資法人	45,597	1,937,872,500	
フロンティア不動産投資法人	3,844	2,052,696,000	
平和不動産リート投資法人	7,080	1,096,692,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,985	2,266,632,500	
福岡リート投資法人	5,358	919,432,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,045	2,168,040,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,489	732,600,700	
大和証券オフィス投資法人	2,165	1,498,180,000	

阪急阪神リート投資法人	4,679	728,520,300	
スタートプロシード投資法人	1,613	407,766,400	
大和ハウスリート投資法人	15,616	4,958,080,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	33,408	2,315,174,400	
大和証券リビング投資法人	14,016	1,715,558,400	
ジャパンエクセレント投資法人	9,503	1,235,390,000	
合計	609,733	116,832,918,200	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2022年 8月22日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	328,860,086
コール・ローン	138,508,795
投資証券	110,687,668,900
未収入金	12,662,616
未収配当金	223,855,523
流動資産合計	111,391,555,920
資産合計	111,391,555,920
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,103
未払解約金	147,699,161
未払利息	58
流動負債合計	147,714,322
負債合計	147,714,322
純資産の部	
元本等	
元本	41,017,034,631
剰余金	
剰余金又は欠損金()	70,226,806,967
元本等合計	111,243,841,598
純資産合計	111,243,841,598
負債純資産合計	111,391,555,920

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 8月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 8月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,017,034,631口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2,7121円 (1万口当たり純資産額) (27,121円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2022年 8月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	41,353,395,001円
期中追加設定元本額	8,505,361,777円
期中一部解約元本額	8,841,722,147円
期末元本額	41,017,034,631円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	58,177,468円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	92,933,067円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,680,837,777円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,304,646円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,379,022,755円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	18,600,063,642円
コア投資戦略ファンド（安定型）	691,010,554円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,599,810,944円
分散投資コア戦略ファンドA	663,634,730円
分散投資コア戦略ファンドS	1,393,496,043円
コア投資戦略ファンド（切替型）	705,693,921円
SMT インデックスバランス・オープン	133,354,303円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	196,056,511円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,692,732円
グローバル経済コア	238,649,777円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,999,209円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	419,178,235円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	69,770,370円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	15,444,550円
10資産分散投資ファンド	3,975円

区分	2022年 8月22日現在
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	891,890,841円
F O F s 用 グローバルR E I Tインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	309,527,177円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	145,019,340円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	83,851,603円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	43,524,822円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 01（適格機関投資家専用）	97,526,469円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 08（適格機関投資家専用）	93,394,478円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 11（適格機関投資家専用）	92,917,911円
S M T A M海外バランスファンド2021 - 04（適格機関投資家専用）	94,468,258円
S M T A M海外バランスファンド2021 - 07（適格機関投資家専用）	92,998,751円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021 - 11（適格機関投資家専用）	110,779,772円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 8月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		11,048,699,198
合計		11,048,699,198

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	126,611,491	-	126,626,594	15,103
	アメリカドル	113,834,500	-	113,834,500	-
	ユーロ	12,776,991	-	12,792,094	15,103
合計		126,611,491	-	126,626,594	15,103

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	55,900	960,921.00	
		AGREE REALTY CORP	41,911	3,323,961.41	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	42,122	815,060.70	
		ALEXANDER'S INC	1,190	301,343.70	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	83,484	13,620,414.60	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	104,082.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,881	916,856.89	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	166,443	6,259,921.23	
		AMERICOLD REALTY TRUST	153,531	4,760,996.31	
		APARTMENT INCOME REIT CO	88,094	3,904,326.08	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	93,351	859,762.71	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	122,364	2,075,293.44	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,600	546,190.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	164,730.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	78,962	16,975,250.76	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	383,575.50	
		BOSTON PROPERTIES	80,339	6,937,272.65	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	156,702.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	810,749.20	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	167,853	3,875,725.77	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	93,466	1,956,243.38	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	124,550.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	59,678	8,492,179.40	
		CARETRUST REIT INC	52,477	1,153,969.23	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	13,620	422,492.40	
		CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	197,064.00	
		CENTERSPACE	9,150	778,116.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	331,455.20	
		CITY OFFICE REIT INC	25,050	313,626.00	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	63,802.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	501,469.14			

CORPORATE OFFICE PPTYS	61,455	1,674,034.20
COUSINS PROPERTIES INC	83,355	2,476,477.05
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	5,000	35,000.00
CTO REALTY GROWTH INC	8,400	184,716.00
CUBESMART	127,586	6,393,334.46
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,079,568.00
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	151,980.00
DIGITAL REALTY TRUST INC	160,653	20,941,118.55
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	206,736.00
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	98,721	2,088,936.36
DUKE REALTY CORP	216,006	13,714,220.94
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	53,307	1,005,903.09
EASTGROUP PROPERTIES, INC	23,190	4,045,495.50
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	614,874.44
EPR PROPERTIES	42,770	2,073,917.30
EQUINIX INC	51,297	35,743,236.63
EQUITY COMMONWEALTH	64,252	1,790,703.24
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	97,444	7,398,922.92
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	192,324	15,089,741.04
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	80,435	1,932,853.05
ESSEX PROPERTY TRUST	36,974	10,722,829.74
EXTRA SPACE STORAGE INC	75,412	15,960,949.80
FARMLAND PARTNERS INC	17,200	253,528.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,733	4,372,616.65
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	73,984	4,043,225.60
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,515	1,267,787.20
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	141,137.11
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	132,532	6,926,122.32
GETTY REALTY CORP	21,985	655,592.70
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	416,299.00
GLADSTONE LAND CORP	15,500	374,635.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	402,070.50
GLOBAL NET LEASE INC	57,012	827,814.24
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	216,667	5,782,842.23
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	302,302	8,410,041.64
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,650	152,470.50
HIGHWOODS PROPERTIES INC	59,171	1,984,595.34
HOST HOTELS AND RESORTS INC	402,606	7,560,940.68
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	79,230	1,148,835.00
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	123,610	2,620,532.00

INDUS REALTY TRUST INC	3,840	245,683.20
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	291,860.80
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	15,495	1,582,504.35
INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,823	1,136,548.42
INVITATION HOMES INC	342,959	13,299,950.02
IRON MOUNTAIN INC	162,860	8,937,756.80
JBG SMITH PROPERTIES	59,353	1,399,543.74
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	307,850.00
KILROY REALTY CORPORATION	58,603	2,995,785.36
KIMCO REALTY CORP	346,470	7,875,263.10
KITE REALTY GROUP TRUST	123,053	2,580,421.41
LIFE STORAGE INC	47,650	6,501,366.00
LTC PROPERTIES INC	23,309	1,047,739.55
LXP INDUSTRIAL TRUST	164,791	1,817,644.73
MACERICH CO/THE	124,305	1,346,223.15
MANULIFE US REAL ESTATE INV	957,964	512,510.74
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	341,592	5,448,392.40
MID-AMERICA APARTMENT COMM	65,294	12,005,607.78
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	98,246	4,611,667.24
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	47,549	2,666,547.92
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,662,742.90
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	71,590	570,572.30
NETSTREIT CORP	25,337	531,063.52
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	754,366.21
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	551,312.30
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	131,562	4,386,277.08
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	226,239.69
ORION OFFICE REIT INC	30,374	315,889.60
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	676,534.04
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	135,515	2,020,528.65
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	72,812	1,399,446.64
PENN REAL ESTATE INVEST TST	2,333	13,064.80
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	64,567	2,209,482.74
PHYSICIANS REALTY TRUST	127,742	2,275,085.02
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	881,653.52
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	24,051	518,780.07
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	113,330.00
PRIME US REIT	295,000	193,225.00
PROLOGIS INC	416,963	55,906,399.04
PUBLIC STORAGE	86,103	30,241,956.69
REALTY INCOME CORP	339,335	24,740,914.85
REGENCY CENTERS CORP	88,278	5,721,297.18

	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	73,582	1,317,117.80
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	92,974	6,215,311.90
	RLJ LODGING TRUST	90,877	1,176,857.15
	RPT REALTY	43,950	461,035.50
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,899	2,739,196.35
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	130,149	2,083,685.49
	SAFEHOLD INC	8,335	365,823.15
	SAUL CENTERS INC	6,800	328,236.00
	SERVICE PROPERTIES TRUST	100,336	767,570.40
	SIMON PROPERTY GROUP	185,318	20,572,151.18
	SITE CENTERS CORP	99,504	1,438,827.84
	SL GREEN REALTY CORP	36,568	1,777,570.48
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	74,906	3,197,737.14
	STAG INDUSTRIAL INC	100,694	3,393,387.80
	STORE CAPITAL CORP	140,414	3,962,483.08
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	65,970	565,362.90
	SUN COMMUNITIES INC	68,804	11,583,841.44
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	124,166	1,458,950.50
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	61,159	1,039,091.41
	TERRENO REALTY CORP	42,326	2,760,078.46
	UDR INC	167,723	8,189,914.09
	UMH PROPERTIES INC	30,629	580,419.55
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	384,770.14
	URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,010,268.00
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	274,361.50
	VENTAS INC	226,148	11,060,898.68
	VERIS RESIDENTIAL INC	42,236	598,906.48
	VICI PROPERTIES INC	543,651	18,821,197.62
	VORNADO REALTY TRUST	89,021	2,572,706.90
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	51,070	1,085,237.50
	WELLTOWER INC	256,172	20,386,167.76
	WHITESTONE REIT	23,074	246,891.80
	WP CAREY INC	107,972	9,501,536.00
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,382	1,111,720.28
	アメリカドル 小計	14,616,692	630,305,077.56 (86,458,947,488)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	34,242	1,128,273.90
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	350,918.10
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	156,240.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,460	670,173.40

	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	75,600.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	48,274	2,254,878.54	
	CHOICE PROPERTIES REIT	93,170	1,340,716.30	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	439,583.58	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	473,351.10	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	69,960	870,302.40	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	269,351.80	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	88,191.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	904,553.65	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,745	1,418,002.95	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	81,239	1,087,790.21	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	44,892.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	41,990	541,671.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	530,136.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	175,935.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	229,957.60	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,000	97,020.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	67,970	889,727.30	
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	108,000.00	
	PRIMARIS REIT	28,309	405,384.88	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	85,984	1,830,599.36	
	SLATE GROCERY REIT	17,300	258,462.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	76,840.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	40,930	1,203,751.30	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	53,000	1,007,530.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	162,282.00	
	カナダドル 小計	1,044,775	19,090,115.37 (2,013,625,369)	
ユーロ	AEDIFICA	21,987	2,238,276.60	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	93,888.00	
	ALTAREA	2,480	342,736.00	
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	336,750.00	
	CARMILA	25,000	409,000.00	
	COFINIMMO	16,697	1,791,588.10	
	COVIVIO(FP)	27,211	1,576,877.45	
	CROMWELL REIT EUR	160,000	339,200.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	21,060	473,850.00	
	GECINA SA	30,472	2,850,655.60	

	HAMBORNER REIT AG	37,000	315,240.00
	ICADE	18,300	833,748.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	123,333.50
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	146,462	921,245.98
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	318,230.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	269,640.00
	KLEPIERRE	109,214	2,359,022.40
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	160,820.00
	MERCIALYS	28,000	239,120.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	190,230	1,843,328.70
	MONTEA NV	6,042	559,489.20
	NSI NV	10,050	323,107.50
	RETAIL ESTATES	6,400	431,360.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	64,866	3,639,631.26
	VASTNED RETAIL	10,650	243,352.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	78,672	2,589,882.24
	WERELDHAVE NV	22,670	330,755.30
	XIOR STUDENT HOUSING NV	12,170	523,918.50
	ユーロ 小計	1,357,723	26,478,046.83 (3,642,055,341)
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	260,756	208,083.28
	AEW UK REIT PLC	68,000	78,200.00
	ASSURA PLC	1,682,040	1,165,653.72
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	435,000	475,020.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	97,668	1,340,004.96
	BRITISH LAND CO PLC	522,803	2,422,669.10
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	488,878	639,452.42
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	264,383.66
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	256,297.94
	DERWENT LONDON PLC	63,472	1,651,541.44
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	303,246.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	140,280	795,387.60
	HAMMERSON PLC	2,044,000	536,141.20
	HOME REIT PLC	419,934	515,678.95
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	229,355	272,932.45
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	432,139	3,056,087.00
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	555,880	1,310,765.04
	LXI REIT PLC	1,061,327	1,575,009.26
	NEWRIVER REIT PL	126,000	109,620.00
PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	250,044.00	

	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	735,888	1,072,188.81	
	PRS REIT PLC/THE	329,000	351,372.00	
	REGIONAL REIT LTD	222,000	164,502.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	118,937	1,353,503.06	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	190,400.00	
	SEGRO PLC	676,336	6,885,100.48	
	SHAFTESBURY PLC	168,193	754,177.41	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	705,099	870,797.26	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	180,111.39	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,045,491	1,911,157.54	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	364,070.00	
	UNITE GROUP PLC	222,248	2,500,290.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	81,347	463,677.90	
	イギリスbond 小計	15,635,660	34,296,835.87 (5,558,831,157)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	239,716	666,410.48	
	ARENA REIT	196,553	864,833.20	
	BWP TRUST	262,160	1,077,477.60	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	676,970.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	309,606	947,394.36	
	CENTURIA OFFICE REIT	240,945	403,582.87	
	CHARTER HALL GROUP	266,135	3,422,496.10	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	334,782	1,493,127.72	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	295,660	1,191,509.80	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	706,275.50	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	822,633	666,332.73	
	DEXUS	609,041	5,578,815.56	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	322,050.00	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	303,407.50	
	GOODMAN GROUP	960,988	19,690,644.12	
	GPT GROUP	1,065,478	4,538,936.28	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	588,662.80	
	HEALTHCO REIT	137,130	245,462.70	
	HOME CONSORTIUM LTD	111,500	545,235.00	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	782,342	1,005,309.47	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	396,093.60	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	193,766	920,388.50	
	MIRVAC GROUP	2,197,238	4,833,923.60	
	NATIONAL STORAGE REIT	605,040	1,488,398.40	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	158,231.20		
RURAL FUNDS GROUP	231,095	612,401.75		
SCENTRE GROUP	2,911,575	8,094,178.50		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	635,659	1,786,201.79		

	STOCKLAND	1,376,971	5,136,101.83	
	VICINITY CENTERS	2,157,067	4,217,065.98	
	WAYPOINT REIT LTD	390,099	1,002,554.43	
オーストラリアドル 小計		18,791,614	73,580,473.37 (6,943,789,271)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	559,152.52	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	605,300	1,349,819.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	879,952.25	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	762,894	1,075,680.54	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	249,502	688,625.52	
ニュージーランドドル 小計		2,893,464	4,553,229.83 (386,341,551)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,108,000	3,855,840.00	
	FORTUNE REIT	836,000	5,693,160.00	
	LINK REIT	1,182,300	74,662,245.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	1,812,320.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,081,310.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,315,660	3,302,306.60	
香港ドル 小計		5,754,960	91,407,181.60 (1,597,797,534)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	376,750.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,928,918	5,748,175.64	
	ASCOTT TRUST	1,117,577	1,285,213.55	
	CAPITALAND CHINA TRUST	647,721	731,924.73	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,924,444	6,141,332.40	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	538,188.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	178,400	126,664.00	
	EC WORLD REIT	180,000	99,900.00	
	ESR-LOGOS REIT	2,769,764	1,163,300.88	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	342,900.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	150,668.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	619,262	1,436,687.84	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,658,196	2,371,220.28	
	IREIT GLOBAL	405,985	237,501.22	
	KEPPEL DC REIT	759,903	1,527,405.03	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,156,540.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	1,025,950	861,798.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,095,163	2,956,940.10	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,798,285	3,218,930.15	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	1,245,273	2,415,829.62	

	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	471,248.28	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	220,500	1,071,630.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	233,682.00	
	SPH REIT	577,800	540,243.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	849,400	496,899.00	
	SUNTEC REIT	1,240,200	1,984,320.00	
	シンガポールドル 小計	25,633,885	37,685,891.72	(3,709,422,321)
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	130,610,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	451,437,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	58,290,540.00	
	JR REIT XXVII	76,683	361,943,760.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	142,679,130.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	372,547,200.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	194,993,000.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	70,260,300.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,380	209,721,000.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	69,442,890.00	
	SK REITS CO LTD	39,229	218,113,240.00	
	韓国ウォン 小計	433,138	2,280,038,060.00	(233,931,904)
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	2,175,570.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	1,229,350.00	
	イスラエルシェケル 小計	218,500	3,404,920.00	(142,926,964)
	合計	86,380,411	110,687,668,900	(110,687,668,900)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 148銘柄	100.0%	78.1%
カナダドル	投資証券 30銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 28銘柄	100.0%	3.3%
イギリスポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.0%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.3%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.3%

香港ドル	投資証券	6銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	投資証券	26銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券	11銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	2銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2022年 8月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	16,288,025
コール・ローン	81,604,129
投資信託受益証券	34,397,616,697
流動資産合計	34,495,508,851
資産合計	34,495,508,851
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,144,866,783
未払解約金	32,850
未払利息	34
流動負債合計	1,144,899,667
負債合計	1,144,899,667
純資産の部	
元本等	
元本	27,864,700,277
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,485,908,907
元本等合計	33,350,609,184
純資産合計	33,350,609,184
負債純資産合計	34,495,508,851

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2022年 8月22日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2022年 8月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	27,864,700,277口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 1.1969円
の額	(1万口当たり純資産額) (11,969円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2022年 8月22日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年 8月22日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月22日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	22,548,739,794円
期中追加設定元本額	8,651,788,730円
期中一部解約元本額	3,335,828,247円
期末元本額	27,864,700,277円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,477,391,331円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,714,459,383円
分散投資コア戦略ファンドA	2,846,783,765円
分散投資コア戦略ファンドS	10,387,799,394円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,673,739,703円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	531,503,932円
グローバル経済コア	877,133,531円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,236,058,493円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	867,992,469円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	150,919,322円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	325,669,531円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	691,451,168円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	83,798,255円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 8月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	58,089,896
合計	58,089,896

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 8月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	34,380,220,511	-	35,525,087,294	1,144,866,783
	アメリカドル	34,380,220,511	-	35,525,087,294	1,144,866,783
合計		34,380,220,511	-	35,525,087,294	1,144,866,783

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	7,564,595	250,766,324.25	
		アメリカドル 小計	7,564,595	250,766,324.25 (34,397,616,697)	
合計			7,564,595	34,397,616,697 (34,397,616,697)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

- 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
- 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【グローバル経済コア】

【純資産額計算書】

(2022年 9月30日現在)

資産総額	10,761,743,522円
負債総額	18,207,032円
純資産総額(-)	10,743,536,490円
発行済口数	8,780,492,365口
1口当たり純資産額(/)	1.2236円
(1万口当たり純資産額)	(12,236円)

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	482,639,704,027円
負債総額	1,858,009,752円
純資産総額(-)	480,781,694,275円
発行済口数	261,939,828,601口
1口当たり純資産額(/)	1.8355円
(1万口当たり純資産額)	(18,355円)

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	627,305,115,755円
負債総額	3,657,573,209円
純資産総額(-)	623,647,542,546円
発行済口数	458,239,606,430口
1口当たり純資産額(/)	1.3610円
(1万口当たり純資産額)	(13,610円)

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	534,917,070,091円
負債総額	5,475,552,151円
純資産総額(-)	529,441,517,940円
発行済口数	128,335,928,077口
1口当たり純資産額(/)	4.1254円
(1万口当たり純資産額)	(41,254円)

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	320,050,506,553円
負債総額	466,782,492円
純資産総額(-)	319,583,724,061円
発行済口数	102,233,099,421口
1口当たり純資産額(/)	3.1260円
(1万口当たり純資産額)	(31,260円)

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	108,117,391,017円
負債総額	461,145,534円
純資産総額(-)	107,656,245,483円
発行済口数	32,090,598,197口
1口当たり純資産額(/)	3.3548円
(1万口当たり純資産額)	(33,548円)

新興国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	86,941,089,897円
負債総額	8,225,061円
純資産総額（ - ）	86,932,864,836円
発行済口数	48,555,631,177口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7904円
（1万口当たり純資産額）	（17,904円）

J - R E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	118,598,037,096円
負債総額	438,989,701円
純資産総額（ - ）	118,159,047,395円
発行済口数	55,144,007,785口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1427円
（1万口当たり純資産額）	（21,427円）

グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	96,393,090,792円
負債総額	321,902,084円
純資産総額（ - ）	96,071,188,708円
発行済口数	41,632,065,722口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3076円
（1万口当たり純資産額）	（23,076円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

(2022年 9月30日現在)

資産総額	33,044,082,392円
負債総額	1,345,049,630円
純資産総額（ - ）	31,699,032,762円

発行済口数	28,034,310,006口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1307円
（1万口当たり純資産額）	（11,307円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2022年 9月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、監査等委員以外取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2022年11月22日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2022年9月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	536	13,725,962
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	212,668
単位型公社債投資信託	51	201,567
合計	655	14,140,196

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

	(単位: 百万円)	
	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,589	21,675
金銭の信託	10,857	14,913
前払費用	397	166
未収委託者報酬	8,471	9,067
未収運用受託報酬	6,151	6,252
未収収益	177	179
その他	3,428	4,891
流動資産合計	51,072	57,146
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 301	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
有形固定資産合計	993	976
無形固定資産		
ソフトウェア	4,104	6,292
その他	41	31
無形固定資産合計	4,145	6,324
投資その他の資産		
投資有価証券	9,950	6,607
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	311	907
その他	39	31
投資その他の資産合計	15,937	13,182
固定資産合計	21,077	20,482
資産合計	72,149	77,629

(単位: 百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
固定負債		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

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

（単位：百万円）

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

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

当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

（2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用 ：発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異 ：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7．収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

（1）投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応

じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

当社は、投資顧問(助言)契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月21日)を適用する予定であります。

(会計方針の変更)

1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日)等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

2. 「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日)第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（未適用の会計基準等）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であり、

（追加情報）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る事業年度末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当事業年度より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、「重要な会計方針6．引当金の計上基準（2）退職給付引当金」をご参照ください。

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	〃	535	〃
そ の 他	4	〃	-	〃
計	503	〃	681	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3．剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。

これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針 8 . ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）*2、*3及び（注2）参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先度が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950
デリバティブ取引（*2）	
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(431)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2022年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1、*2）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	-	196	-	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	-	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(71)	-	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	-	(1,485)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

(*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）

(単位:百万円)

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

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

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

2．その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

当事業年度（2022年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
	合計	6,915	-	80	80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引				
株価指数先物取引 売建	17,197	-	1,333	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
--------------	----	---------	---------------	-------------------------	-------------

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
	合計		8,057	-	71

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は従来簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
退職給付債務の期首残高	600		626	
勤務費用	-		124	
利息費用	-		2	
転籍者受入	18		-	
退職給付の支払額	69		81	
簡便法で計算した退職給付費用	77		8	
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-		120	
その他	-		18	
退職給付債務の期末残高	626		820	

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

(単位：百万円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

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

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

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2021年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2022年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

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

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

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年11月22日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2022年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	17,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2022年3月末日現在）

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

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年11月19日	有価証券届出書
2021年11月19日	有価証券報告書
2022年 5月20日	有価証券届出書
2022年 5月20日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. 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11月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

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」に掲げられているグローバル経済コアの2021年8月21日から2022年8月22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、グローバル経済コアの2022年8月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。