

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年1月20日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	SMT インデックスバランス・オープン
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

SMT インデックスバランス・オープン

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜 3.0%）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

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

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資さ

れるコース)で再投資する場合は1円以上1円単位です。

(7)【申込期間】

2023年 1月21日から2023年 7月20日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

(8)【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9)【払込期日】

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

<振替受益権について>

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎても

お申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、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、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、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 ()	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				
不動産投信	年12回 (毎月)	欧州				その他 ()
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))	日々	アジア				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型	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				

(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。

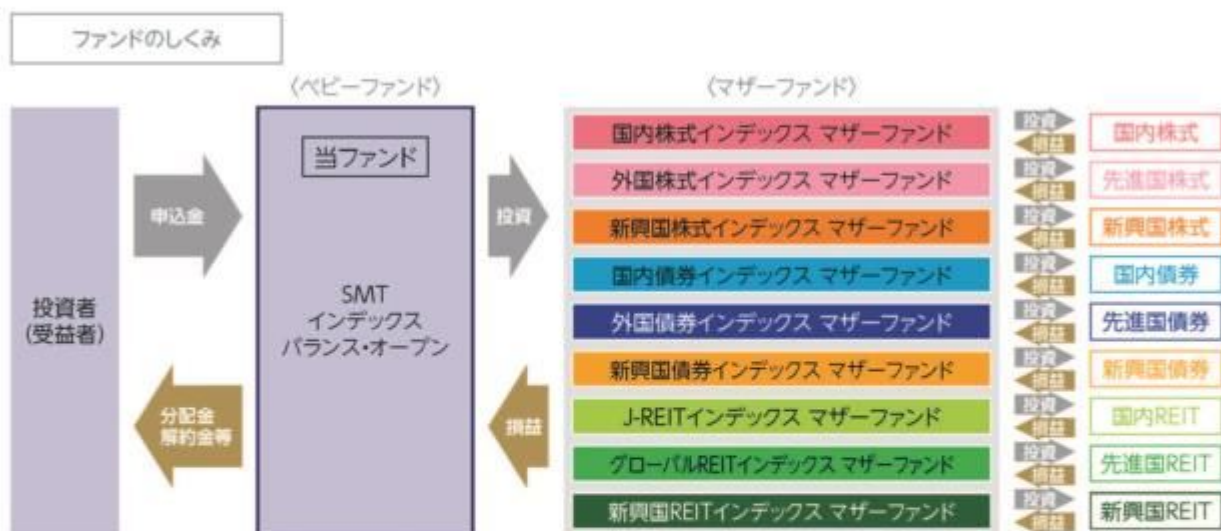
[特殊型]

- (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 >

特色1 世界の株式(DR(預託証券)を含みます。)、債券及び不動産投資信託証券(REIT)に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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



? ファ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。

? REITとは

REITは Real Estate Investment Trust の略称です。
REITは、投資者から集めた資金で、不動産への投資を行い、そこから得られる賃貸料収入や不動産の売買益を原資として投資者に配当する商品です。

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資産配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、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。

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本資産配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

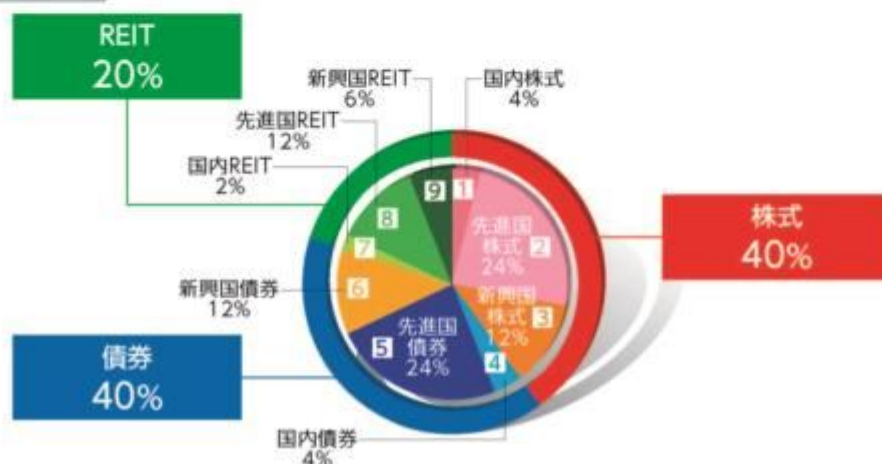
ファンドマネジャー

●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

特色2 株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。

基本資産配分比率
(2022年11月末現在)



●市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で資産配分比率を調整します。

資産	インデックス
1 国内株式	TOPIX(東証株価指数) ※1
2 先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス(円ベース) ※2
3 新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース) ※3
4 国内債券	NOMURA-BPI総合※4
5 先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) ※5
6 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース) ※6
7 国内REIT	東証REIT指数(配当込み) ※7
8 先進国REIT	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース) ※8
9 新興国REIT	S&P新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース) ※9

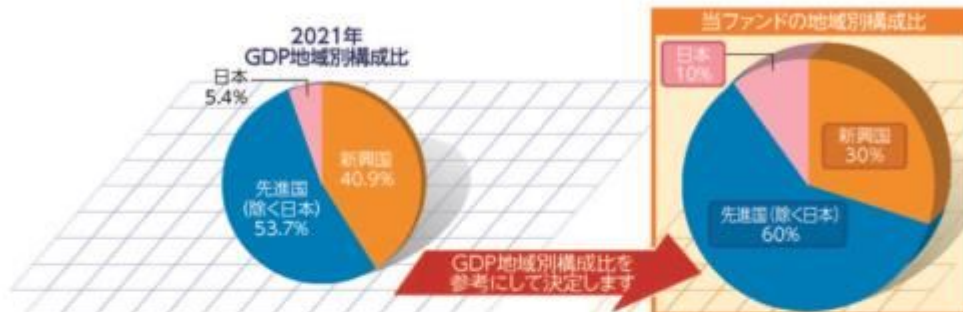
* 資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

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

- ※1 「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準又は商標は、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準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。
- ※2 「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。
- ※3 「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。
- ※4 「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。
- ※5 「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。
- ※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・ディバーシファイド(円換算ベース)」とは、新興国の現地通貨債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。
- ※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準又は商標は、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準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。
- ※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「SPDJI」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJI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SPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、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を負いません。
- ※9 「S&P新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJI」)が公表する指数で、新興国に上場する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新興国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJI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SPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、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を負いません。

特色3 世界経済全体の発展を享受します。

- 地域別の基本組入比率は、地域別(国内、先進国及び新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率を参考に決定するものとします。また、基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
 - 地域別の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。
- ※地域別の基本組入比率は市場動向等を勘案して調整を行うことがあります。



(出所) IMF「世界経済見通し2021年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※当ファンドの地域別構成比は、2022年11月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

分配方針

- 年2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、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
- 投資信託証券(REIT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。
- 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】

2014年11月28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11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「新興国REITインデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」という場合があります。）の各受益証券（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。

投資態度

- イ．主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（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。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかります。
- ロ．株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整します。
- ハ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（国内、先進国及び新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定するものとします。また、マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ニ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。
- ホ．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。
- ヘ．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ません。）
 - 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「新興国REITインデックス マザーファンド」の各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書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券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せん。）
 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せん。）
 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）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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。

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

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ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第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。

「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めざして、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

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なら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。

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なら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。

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内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なら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、なら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

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。

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内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なら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、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債、なら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。

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

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なら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なら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なら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。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内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なら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、なら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

株式への投資は行いません。

同一銘柄の転換社債なら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。

「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）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、ならびに東証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。

「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（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（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）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。

「新興国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、新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）に上場しているREITに投資し、S&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）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

主として、新興国のREITに投資し、S&P新興国REIT指数（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。

REITへの投資割合は、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。

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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

株式への投資は行いません。

同一銘柄のREIT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新興国REIT指数（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新興国REIT指数（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。

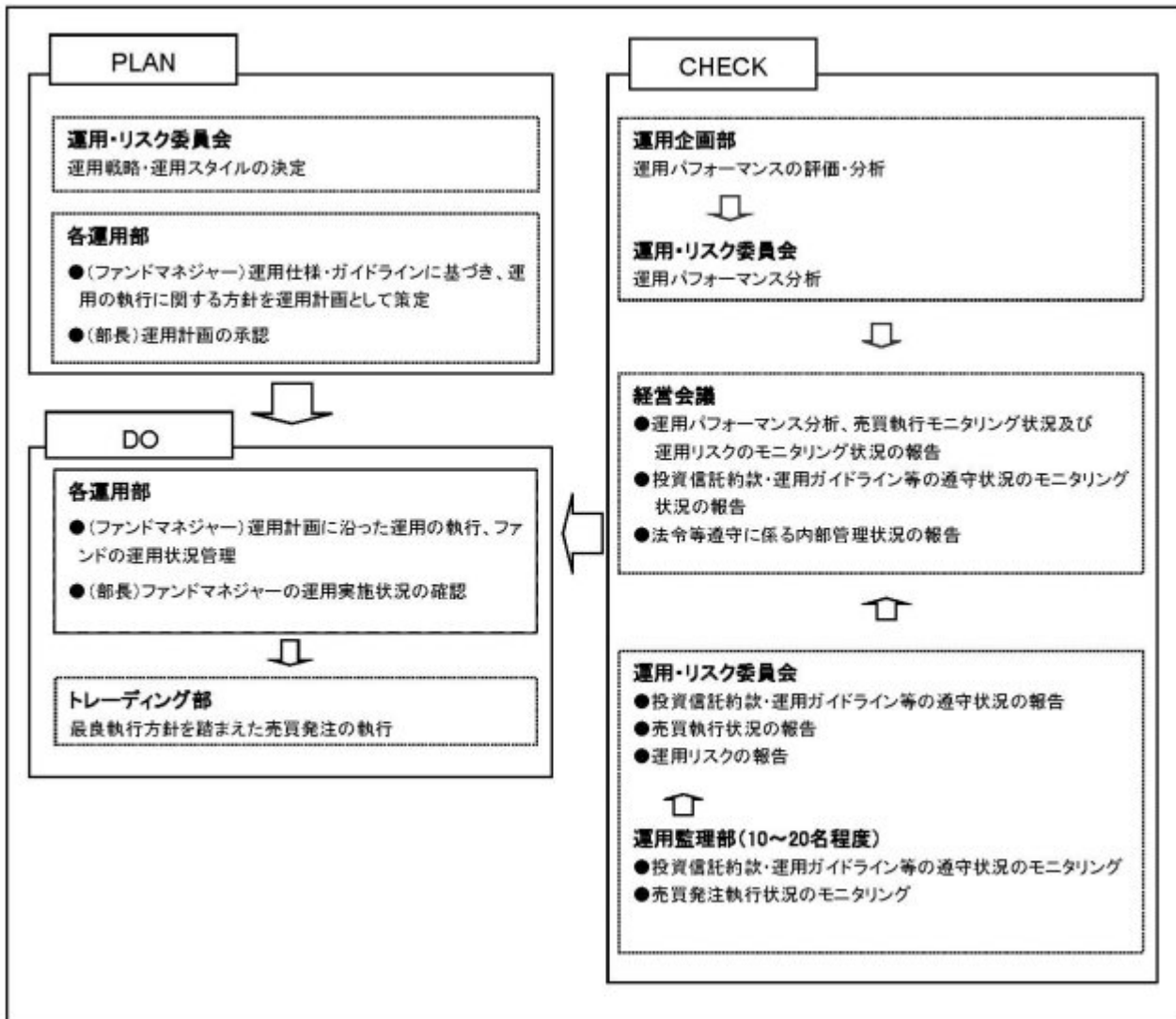
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(3)【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

- ・年2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．株式等への投資割合

株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%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（REIT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（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に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、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

ヘ．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。
- (ハ) 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ます。

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

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

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ワ．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。

フ．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す。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

（二）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。

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。

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。

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。

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>

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がある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

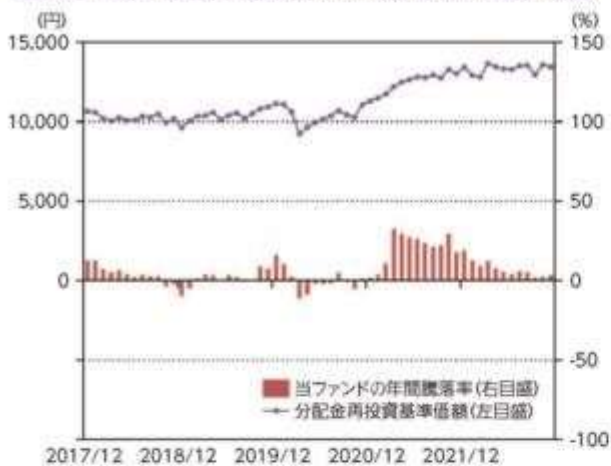
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2017年12月～2022年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 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権利又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募認定利付国債の市場全体の動きを表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの権限、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、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPEL(エムエル)グローバル・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・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。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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 0.55%（税抜 0.5%）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 0.22% (税抜 0.2%)	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 0.275% (税抜 0.25%)	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おりません。

（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。

二．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11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11月30日現在の状況について記載してあります。

【SMT インデックスバランス・オープン】

（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	2,673,221,147	99.09
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		24,532,689	0.91
合計（純資産総額）		2,697,753,836	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、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	外国株式インデックス マザーファンド	156,521,334	4.3419	679,599,981	4.3873	686,706,048	25.45
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	197,330,373	3.1783	627,175,125	3.1207	615,808,895	22.83
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	132,935,194	2.3756	315,800,847	2.4538	326,196,379	12.09
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	168,939,332	1.8283	308,871,781	1.8309	309,311,022	11.47
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	83,626,923	3.4376	287,475,911	3.5156	293,998,810	10.90
日本	親投資信託受益証券	新興国REITインデックス マザーファンド	240,952,881	0.7515	181,076,091	0.7682	185,100,003	6.86
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	58,072,978	1.8951	110,054,101	1.9858	115,321,319	4.27
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	61,489,246	1.3503	83,028,929	1.3528	83,182,651	3.08
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	26,429,892	2.0601	54,448,221	2.1792	57,596,020	2.13

(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	99.09
合計	99.09

(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 (2015年 4月20日)	1,069,183,722	1,069,183,722	10,012	10,012
第2期計算期間末 (2015年10月20日)	1,758,605,423	1,758,605,423	9,509	9,509
第3期計算期間末 (2016年 4月20日)	2,345,268,549	2,345,268,549	9,025	9,025
第4期計算期間末 (2016年10月20日)	2,640,506,750	2,640,506,750	8,729	8,729
第5期計算期間末 (2017年 4月20日)	3,071,863,389	3,071,863,389	9,344	9,344
第6期計算期間末 (2017年10月20日)	3,210,063,471	3,210,063,471	10,386	10,386
第7期計算期間末 (2018年 4月20日)	3,051,290,712	3,051,290,712	10,234	10,234
第8期計算期間末 (2018年10月22日)	2,916,459,886	2,916,459,886	10,043	10,043
第9期計算期間末 (2019年 4月22日)	2,897,788,604	2,897,788,604	10,631	10,631
第10期計算期間末 (2019年10月21日)	2,862,769,922	2,862,769,922	10,703	10,703
第11期計算期間末 (2020年 4月20日)	2,311,876,858	2,311,876,858	9,578	9,578
第12期計算期間末 (2020年10月20日)	2,413,136,341	2,413,136,341	10,586	10,586
第13期計算期間末 (2021年 4月20日)	2,520,767,080	2,520,767,080	12,311	12,311
第14期計算期間末 (2021年10月20日)	2,749,895,621	2,749,895,621	13,320	13,320
第15期計算期間末 (2022年 4月20日)	2,792,857,082	2,792,857,082	13,960	13,960
第16期計算期間末 (2022年10月20日)	2,684,376,098	2,684,376,098	13,327	13,327
2021年11月末日	2,671,528,037		13,031	
12月末日	2,715,159,998		13,432	
2022年 1月末日	2,588,383,969		12,914	
2月末日	2,571,635,683		12,806	
3月末日	2,736,324,253		13,662	
4月末日	2,680,464,525		13,448	
5月末日	2,660,376,928		13,325	
6月末日	2,671,514,297		13,292	
7月末日	2,722,490,378		13,507	
8月末日	2,723,944,280		13,549	
9月末日	2,600,950,522		12,947	
10月末日	2,737,708,385		13,591	
11月末日	2,697,753,836		13,446	

【分配の推移】

	期 間	1万円当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年 4月20日	0
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	0
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	0
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	0
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	0
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	0
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	0
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	0
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	0
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	0
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	0
第12期計算期間	2020年 4月21日～2020年10月20日	0
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年 4月20日	0
第14期計算期間	2021年 4月21日～2021年10月20日	0
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年 4月20日	0
第16期計算期間	2022年 4月21日～2022年10月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年 4月20日	0.1
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	5.0
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	5.1
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	3.3
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	7.0
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	11.2
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	1.5
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	1.9
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	5.9
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	0.7
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	10.5
第12期計算期間	2020年 4月21日～2020年10月20日	10.5
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年 4月20日	16.3
第14期計算期間	2021年 4月21日～2021年10月20日	8.2
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年 4月20日	4.8
第16期計算期間	2022年 4月21日～2022年10月20日	4.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年4月20日	1,226,719,421	158,784,152	1,067,935,269
第2期計算期間	2015年4月21日～2015年10月20日	1,116,037,756	334,592,586	1,849,380,439
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年4月20日	1,083,752,766	334,386,357	2,598,746,848
第4期計算期間	2016年4月21日～2016年10月20日	602,284,502	175,969,377	3,025,061,973
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年4月20日	856,851,109	594,236,350	3,287,676,732
第6期計算期間	2017年4月21日～2017年10月20日	584,835,788	781,663,341	3,090,849,179
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年4月20日	473,012,411	582,449,995	2,981,411,595
第8期計算期間	2018年4月21日～2018年10月22日	199,195,642	276,588,300	2,904,018,937
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年4月22日	166,800,463	345,148,199	2,725,671,201
第10期計算期間	2019年4月23日～2019年10月21日	156,918,897	207,929,245	2,674,660,853
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年4月20日	163,015,795	423,953,521	2,413,723,127
第12期計算期間	2020年4月21日～2020年10月20日	126,592,041	260,782,440	2,279,532,728
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年4月20日	92,056,120	324,043,645	2,047,545,203
第14期計算期間	2021年4月21日～2021年10月20日	106,905,068	90,001,351	2,064,448,920
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年4月20日	85,522,955	149,318,352	2,000,653,523
第16期計算期間	2022年4月21日～2022年10月20日	91,167,976	77,540,998	2,014,280,501

(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	509,187,383,130	98.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,722,127,455	1.30
合計(純資産総額)		515,909,510,585	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	6,407,800,000	1.24

(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	9,751,100	2,119.42	20,666,676,362	2,010.50	19,604,586,550	3.80
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,256,200	11,951.98	15,014,077,276	11,255.00	14,138,531,000	2.74
日本	株式	キーエンス	電気機器	177,700	51,490.71	9,149,899,167	57,140.00	10,153,778,000	1.97
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,282,200	3,986.39	9,097,739,258	3,820.00	8,718,004,000	1.69
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,466,500	737.76	8,459,525,040	755.10	8,658,354,150	1.68
日本	株式	第一三共	医薬品	1,551,600	3,542.34	5,496,294,744	4,518.00	7,010,128,800	1.36
日本	株式	任天堂	その他製品	1,121,200	5,834.75	6,541,921,700	5,894.00	6,608,352,800	1.28
日本	株式	日立製作所	電気機器	900,500	6,769.40	6,095,844,700	7,299.00	6,572,749,500	1.27
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,576,200	3,747.25	5,906,415,450	4,050.00	6,383,610,000	1.24
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,029,800	5,360.67	5,520,417,966	5,952.00	6,129,369,600	1.19
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,278,100	3,983.90	5,091,822,590	4,673.00	5,972,561,300	1.16
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,351,600	4,683.47	6,330,178,052	4,329.00	5,851,076,400	1.13
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,376,300	4,538.69	6,246,599,047	4,111.00	5,657,969,300	1.10
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	125,300	58,968.27	7,388,724,231	45,090.00	5,649,777,000	1.10
日本	株式	三井物産	卸売業	1,374,800	3,183.26	4,376,345,848	3,983.00	5,475,828,400	1.06
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,174,800	4,484.81	5,268,754,788	4,605.00	5,409,954,000	1.05
日本	株式	HOYA	精密機器	383,700	13,946.61	5,351,314,257	14,060.00	5,394,822,000	1.05
日本	株式	信越化学工業	化学	304,400	18,182.69	5,534,810,836	17,570.00	5,348,308,000	1.04
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,761,200	2,471.41	4,352,647,292	2,827.00	4,978,912,400	0.97
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,157,800	3,722.16	4,309,516,848	4,287.00	4,963,488,600	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,443,500	3,189.02	4,603,350,370	3,356.00	4,844,386,000	0.94
日本	株式	ダイキン工業	機械	214,100	20,695.00	4,430,799,500	22,405.00	4,796,910,500	0.93
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,529,400	1,535.35	3,883,514,290	1,717.00	4,342,979,800	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,861,300	1,492.31	4,269,946,603	1,497.50	4,284,796,750	0.83
日本	株式	村田製作所	電気機器	538,600	8,224.49	4,429,710,314	7,464.00	4,020,110,400	0.78

日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	193,200	19,685.82	3,803,300,424	19,720.00	3,809,904,000	0.74
日本	株式	日本電産	電気機器	435,600	8,640.55	3,763,823,580	8,534.00	3,717,410,400	0.72
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,706,800	2,044.82	3,490,098,776	2,128.00	3,632,070,400	0.70
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	647,600	5,411.47	3,504,467,972	5,579.00	3,612,960,400	0.70
日本	株式	S M C	機械	58,200	66,196.12	3,852,614,184	61,760.00	3,594,432,000	0.70

(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	0.09
		鉱業	0.32
		建設業	1.92
		食料品	3.45
		繊維製品	0.44
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.07
		医薬品	5.69
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.73
		ガラス・土石製品	0.69
		鉄鋼	0.71
		非鉄金属	0.72
		金属製品	0.56
		機械	5.10
		電気機器	17.22
		輸送用機器	7.65
		精密機器	2.71
		その他製品	2.33
		電気・ガス業	1.18
		陸運業	3.14
		海運業	0.59
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	8.71
		卸売業	5.86
小売業	4.43		
銀行業	5.49		
証券、商品先物取引業	0.73		
保険業	2.33		

	その他金融業	1.10
	不動産業	2.09
	サービス業	5.32
	小計	98.70
合計		98.70

(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	322	円	6,039,537,400	6,407,800,000	1.24

(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	525,732,645,050	84.40
地方債証券	日本	32,155,755,762	5.16
特殊債券	日本	36,139,187,817	5.80
社債券	日本	26,538,072,000	4.26
	フランス	894,628,000	0.14
	スペイン	396,188,000	0.06
	小計	27,828,888,000	4.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,056,341,641	0.17
合計(純資産総額)		622,912,818,270	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	100.24	7,668,589,500	0.100	2024/9/20	1.23
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	6,860,000,000	100.06	6,864,116,000	99.81	6,847,514,800	0.005	2026/12/20	1.10
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,680,000,000	100.12	6,688,016,000	99.96	6,677,595,200	0.005	2026/6/20	1.07
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,390,000,000	100.33	6,411,087,000	99.84	6,379,903,800	0.100	2028/3/20	1.02
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	6,250,000,000	98.85	6,178,728,600	98.41	6,150,625,000	0.100	2031/12/20	0.99
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	100.51	5,930,503,000	100.26	5,915,635,000	0.100	2026/9/20	0.95
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	100.48	5,777,600,000	100.12	5,757,360,000	0.100	2027/3/20	0.92
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,740,000,000	99.71	5,723,354,000	100.13	5,747,863,800	0.200	2032/3/20	0.92
日本	国債証券	第139回利付国債(5年)	5,590,000,000	100.30	5,607,105,400	100.20	5,601,571,300	0.100	2024/3/20	0.90
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,430,000,000	100.46	5,455,463,000	100.30	5,446,724,400	0.100	2025/9/20	0.87
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	99.67	5,397,130,500	0.100	2028/12/20	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	99.67	5,342,472,800	0.200	2032/6/20	0.86
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,320,000,000	99.99	5,319,499,400	99.95	5,317,446,400	0.100	2027/9/20	0.85
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	5,230,000,000	100.45	5,253,535,000	100.29	5,245,323,900	0.100	2025/6/20	0.84
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	5,120,000,000	101.21	5,181,952,000	100.93	5,167,667,200	0.300	2025/12/20	0.83
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	5,250,000,000	99.09	5,202,708,000	98.41	5,166,735,000	0.100	2031/6/20	0.83
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	99.61	5,070,352,600	0.005	2027/6/20	0.81
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,110,000,000	99.01	5,059,411,000	98.32	5,024,458,600	0.100	2031/9/20	0.81
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	4,930,000,000	100.41	4,950,213,000	99.87	4,923,788,200	0.100	2027/12/20	0.79
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	4,840,000,000	100.27	4,853,068,000	99.77	4,829,303,600	0.100	2028/6/20	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	98.73	4,828,288,200	0.100	2030/9/20	0.78
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	99.90	4,815,421,000	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	100.31	4,774,898,800	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	99.59	4,770,552,600	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	100.26	4,762,540,000	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	101.05	4,719,408,600	0.400	2025/6/20	0.76
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	4,780,000,000	99.26	4,745,020,600	98.62	4,714,083,800	0.100	2030/12/20	0.76
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	100.95	4,603,502,400	0.400	2025/3/20	0.74
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	4,430,000,000	101.47	4,495,121,000	101.14	4,480,900,700	0.400	2025/9/20	0.72

日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	4,460,000,000	100.42	4,478,738,000	99.95	4,457,859,200	0.100	2027/9/20	0.72
----	------	----------------	---------------	--------	---------------	-------	---------------	-------	-----------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□. 種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.40
地方債証券	5.16
特殊債券	5.80
社債券	4.47
合計	99.83

(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	373,004,461,753	66.50
	イギリス	24,038,445,053	4.29
	カナダ	20,733,892,972	3.70
	スイス	18,181,098,563	3.24
	フランス	17,509,719,801	3.12
	ドイツ	13,108,300,555	2.34
	オーストラリア	11,942,753,878	2.13
	オランダ	10,127,564,997	1.81
	アイルランド	9,827,267,922	1.75
	スウェーデン	5,222,718,928	0.93
	デンマーク	4,502,578,232	0.80
	スペイン	3,944,398,381	0.70
	香港	3,281,543,272	0.59
	イタリア	2,937,832,257	0.52
	フィンランド	1,999,732,903	0.36

	シンガポール	1,943,813,019	0.35
	ジャージー	1,814,373,517	0.32
	ベルギー	1,317,439,219	0.23
	ノルウェー	1,274,470,241	0.23
	イスラエル	1,249,336,552	0.22
	ケイマン	1,006,060,724	0.18
	バミューダ	819,352,589	0.15
	キュラソー	797,732,091	0.14
	ルクセンブルク	396,621,577	0.07
	ニュージーランド	382,548,681	0.07
	オーストリア	330,127,452	0.06
	ポルトガル	285,566,001	0.05
	リベリア	139,543,007	0.02
	マン島	115,293,679	0.02
	パナマ	114,223,318	0.02
	小計	532,348,811,134	94.91
投資信託受益証券	オーストラリア	160,074,688	0.03
	香港	74,276,483	0.01
	アメリカ	5,583,198	0.00
	小計	239,934,369	0.04
投資証券	アメリカ	10,543,201,589	1.88
	オーストラリア	669,862,669	0.12
	シンガポール	260,526,334	0.05
	イギリス	226,665,601	0.04
	フランス	215,980,624	0.04
	香港	159,456,374	0.03
	カナダ	55,276,671	0.01
	ベルギー	47,689,821	0.01
	小計	12,178,659,683	2.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		16,151,585,753	2.88
合計(純資産総額)		560,918,990,939	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	11,774,342,916	2.10
	買建	カナダ	779,452,195	0.14
	買建	ドイツ	2,534,387,949	0.45
	買建	イギリス	375,363,963	0.07

買建	オーストラリア	488,400,165	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		763,682,150	0.14

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,323,830	20,827.89	27,572,586,547	19,604.27	25,952,731,212	4.63
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	581,193	37,965.24	22,065,131,902	33,374.62	19,397,099,648	3.46
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	749,309	16,083.16	12,051,258,790	12,834.36	9,616,905,503	1.71
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	492,726	15,612.49	7,692,684,433	13,219.03	6,513,362,387	1.16
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	460,933	15,684.68	7,229,587,604	13,253.75	6,109,092,039	1.09
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	76,869	70,477.67	5,417,548,486	73,323.36	5,636,293,360	1.00
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	216,377	35,284.53	7,634,762,134	25,111.86	5,433,629,386	0.97
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	343,717	13,535.99	4,652,552,284	15,350.68	5,276,293,046	0.94
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	25,078.62	5,407,979,116	24,453.61	5,273,202,704	0.94
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	105,127	44,241.30	4,650,956,064	43,762.10	4,600,578,613	0.82
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	240,076	18,199.15	4,369,181,322	18,964.08	4,552,822,199	0.81
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	205,210	26,039.71	5,343,610,766	21,717.87	4,456,726,011	0.79
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	196,677	20,627.08	4,056,873,481	20,202.80	3,973,427,590	0.71
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	134,653	29,557.34	3,979,985,217	29,032.16	3,909,267,737	0.70

アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	153,061	24,691.08	3,779,242,314	25,139.63	3,847,897,841	0.69
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	230,976	16,977.11	3,921,306,434	16,207.24	3,743,484,436	0.67
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	84,000	42,827.50	3,597,510,672	43,877.36	3,685,698,677	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	70,879	49,665.62	3,520,249,960	47,650.46	3,377,417,174	0.60
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	44,813.49	2,968,535,596	50,541.73	3,347,985,709	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	20,782.22	3,012,446,252	21,969.23	3,184,506,376	0.57
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	460,155	7,459.33	3,432,449,857	6,872.67	3,162,496,363	0.56
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	12,900.97	2,676,539,492	15,114.61	3,135,798,073	0.56
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	591,261	5,137.07	3,037,352,561	5,138.19	3,038,011,358	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	337,769	8,969.93	3,029,766,536	8,676.59	2,930,685,695	0.52
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	113,421	23,851.58	2,705,270,772	25,356.27	2,875,933,874	0.51
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	187,450	27,049.90	5,070,504,859	15,200.71	2,849,373,127	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	33,358	77,658.59	2,590,535,463	80,376.08	2,681,185,410	0.48
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	36,343	65,593.56	2,383,866,961	73,456.67	2,669,635,947	0.48
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	124,048	17,846.25	2,213,792,206	21,242.94	2,635,144,705	0.47
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	57,316	47,966.01	2,749,220,326	45,048.44	2,581,996,817	0.46

(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	5.84
		素材	4.31
		資本財	6.45
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	1.92
		自動車・自動車部品	1.83
		耐久消費財・アパレル	1.54

	消費者サービス	1.86
	メディア・娯楽	4.75
	小売	4.38
	食品・生活必需品小売り	1.60
	食品・飲料・タバコ	4.30
	家庭用品・パーソナル用品	1.76
	ヘルスケア機器・サービス	4.89
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.13
	銀行	5.97
	各種金融	4.72
	保険	3.29
	不動産	0.37
	ソフトウェア・サービス	10.05
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.08
	電気通信サービス	1.41
	公益事業	3.07
	半導体・半導体製造装置	4.22
	小計	94.91
投資信託受益証券		0.04
投資証券		2.17
合計		97.12

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	428	アメリカドル	83,910,961	11,652,715,154	84,786,800	11,774,342,916	2.10
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	31	カナダドル	7,253,899.5	741,058,373	7,629,720	779,452,195	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	58	スイスフラン	6,165,326	898,103,038	6,424,660	935,880,222	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	283	ユーロ	10,031,053.5	1,440,258,661	11,133,220	1,598,507,727	0.28
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	29	オーストラリアドル	5,060,178	469,533,917	5,263,500	488,400,165	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	30	イギリスポンド	2,138,522.5	355,486,595	2,258,100	375,363,963	0.07

(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	5,500,000.00	763,785,000	763,682,150	0.14

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

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

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	149,169,845,308	49.32
	フランス	25,549,805,357	8.45
	イタリア	22,792,328,179	7.54
	ドイツ	19,799,954,424	6.55
	スペイン	15,380,507,109	5.09
	イギリス	14,119,402,755	4.67
	中国	9,793,563,793	3.24
	カナダ	6,125,996,632	2.03
	ベルギー	5,641,135,585	1.87
	オランダ	4,792,059,920	1.58
	オーストラリア	4,581,886,215	1.51
	オーストリア	3,540,212,531	1.17
	メキシコ	2,515,945,412	0.83
	アイルランド	1,918,965,899	0.63
	マレーシア	1,565,456,592	0.52
	フィンランド	1,508,676,385	0.50
	シンガポール	1,379,813,940	0.46
	ポーランド	1,266,316,079	0.42
	デンマーク	1,092,879,272	0.36
	イスラエル	1,085,498,327	0.36
	スウェーデン	760,533,640	0.25
	ニュージーランド	619,149,165	0.20
ノルウェー	604,812,471	0.20	
	小計	295,604,744,990	97.74

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,846,909,696	2.26
合計(純資産総額)		302,451,654,686	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,944,954,677	0.64
	買建	ドイツ	1,780,270,674	0.59

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		4,466,111,307	1.48

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	21,030,000	12,214.22	2,568,651,501	11,396.01	2,396,582,875	1.375	2031/11/15	0.79
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	12,653.98	1,834,828,017	11,959.09	1,734,068,615	1.250	2028/9/30	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	13,755.72	1,835,013,650	12,894.29	1,720,099,160	2.625	2029/2/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	12,172.82	1,832,009,926	11,416.63	1,718,203,259	1.125	2031/2/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	13,371.66	1,738,316,083	13,111.82	1,704,537,036	0.250	2024/3/15	0.56
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	79,870,000	1,927.35	1,539,377,949	1,921.89	1,535,014,527	1.990	2025/4/9	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	13,380,000	12,176.12	1,629,165,070	11,341.77	1,517,529,264	1.250	2031/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,602.03	1,590,077,513	12,952.88	1,514,191,945	2.375	2027/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	11,530,000	13,283.79	1,531,621,672	12,857.40	1,482,459,282	2.250	2027/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.25% 11/15/23	11,000,000	13,492.63	1,484,189,395	13,305.48	1,463,603,006	0.250	2023/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	12,785.26	1,512,496,469	12,269.92	1,451,532,006	0.750	2026/8/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.5% 04/30/27	11,940,000	12,235.63	1,460,934,446	11,927.08	1,424,094,386	0.500	2027/4/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	13,283.78	1,442,618,881	12,912.46	1,402,294,126	0.750	2024/11/15	0.46

アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,503.36	1,465,394,383	11,862.53	1,390,289,192	1.875	2032/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/31/25	10,900,000	12,714.65	1,385,897,882	12,552.54	1,368,227,524	0.250	2025/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	13,774.71	1,398,133,120	13,301.95	1,350,148,516	2.250	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	12,000,000	11,806.72	1,416,807,288	11,071.62	1,328,595,336	0.625	2030/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	13,403.39	1,340,339,606	13,184.51	1,318,451,305	0.125	2024/1/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,743.19	1,403,311,728	11,010.87	1,315,799,224	0.625	2030/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	12,667.54	1,412,431,581	11,776.82	1,313,116,213	1.625	2031/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	13,448.69	1,374,456,278	12,825.94	1,310,811,722	2.000	2026/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	13,307.92	1,330,792,293	13,018.52	1,301,852,007	0.250	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,956.92	1,333,197,031	11,205.07	1,249,365,653	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	12,570.44	1,283,442,666	11,892.91	1,214,266,478	1.125	2028/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	12,524.64	1,189,841,451	12,385.46	1,176,619,472	0.750	2026/4/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	13,283.24	1,196,820,015	12,968.07	1,168,423,219	0.375	2024/7/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	13,275.10	1,194,759,366	12,975.12	1,167,761,088	0.250	2024/6/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/30/27	9,880,000	11,768.43	1,162,721,085	11,704.67	1,156,422,344	0.375	2027/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	13,582.67	1,215,649,810	12,919.24	1,156,272,846	2.250	2027/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	13,496.77	1,187,716,226	13,096.90	1,152,527,697	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	97.74
合計	97.74

(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

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	50	アメリカ ドル	5,412,093.26	751,577,390	5,405,859.5	750,711,708	0.25
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	38	アメリカ ドル	4,306,676.82	598,068,210	4,293,406.44	596,225,352	0.20
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	34	アメリカ ドル	4,332,626.52	601,671,845	4,306,312.5	598,017,617	0.20
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	21	ユーロ	2,241,524.1	321,838,030	2,244,795	322,307,666	0.11
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	28	ユーロ	3,350,478.8	481,061,746	3,368,120	483,594,669	0.16

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	48	ユーロ	6,713,020.8	963,855,526	6,786,240	974,368,339	0.32
-----	-----------------------	-----------	----	----	-----	-------------	-------------	-----------	-------------	------

(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	17,240,000.00	2,403,024,561	2,389,291,600	0.79
	カナダドル	買建	1,560,000.00	163,055,548	159,096,600	0.05
	ユーロ	買建	11,030,000.00	1,594,863,386	1,582,529,250	0.52
	イギリスポンド	買建	1,240,000.00	205,641,018	205,815,200	0.07
	オフショア人民元	買建	6,670,000.00	130,706,584	129,378,657	0.04

(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	18,309,888,207	15.95
	インド	16,579,531,780	14.44
	台湾	15,579,711,395	13.57
	中国	13,237,919,812	11.53
	韓国	13,151,055,916	11.46
	ブラジル	5,691,273,790	4.96
	サウジアラビア	4,562,903,320	3.97
	南アフリカ	4,007,985,051	3.49
	メキシコ	2,539,113,238	2.21
	タイ	2,357,630,066	2.05
	インドネシア	2,241,228,167	1.95
	マレーシア	1,661,408,661	1.45
	アラブ首長国連邦	1,424,063,678	1.24
	香港	1,318,849,995	1.15
	カタール	1,199,256,392	1.04

	クウェート	1,075,659,104	0.94
	フィリピン	837,297,432	0.73
	ポーランド	719,457,140	0.63
	バミューダ	625,057,592	0.54
	チリ	614,940,738	0.54
	トルコ	554,989,218	0.48
	アメリカ	496,695,832	0.43
	ギリシャ	322,420,844	0.28
	ハンガリー	235,510,185	0.21
	チェコ	203,250,814	0.18
	コロンビア	174,004,029	0.15
	ルクセンブルク	120,606,643	0.11
	エジプト	76,281,846	0.07
	シンガポール	24,691,619	0.02
	ペルー	18,832,064	0.02
	ロシア	173	0.00
	小計	109,961,514,741	95.78
投資信託受益証券	ブラジル	214,742,044	0.19
	メキシコ	54,527,263	0.05
	小計	269,269,307	0.23
投資証券	メキシコ	67,922,747	0.06
	南アフリカ	55,237,362	0.05
	小計	123,160,109	0.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,447,512,348	3.87
合計(純資産総額)		114,801,456,505	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	4,421,361,113	3.85

(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		546,256,465	0.48
	売建		124,949,430	0.11

(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	3,132,389	1,872.41	5,865,127,138	2,186.72	6,849,680,854	5.97
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	792,900	4,210.30	3,338,350,042	5,081.52	4,029,140,380	3.51
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	603,658	6,497.60	3,922,328,221	6,350.87	3,833,759,519	3.34
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	1,930,988	1,173.47	2,265,975,798	1,400.17	2,703,721,123	2.36
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	387,099	4,451.13	1,723,027,972	4,635.89	1,794,550,512	1.56
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	558,900	2,565.65	1,433,944,021	2,763.01	1,544,247,407	1.35
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	428,668	2,582.52	1,107,046,899	2,784.39	1,193,580,179	1.04
ブラジル	株式	VALE SA	素材	509,587	1,921.78	979,318,938	2,218.39	1,130,467,411	0.98
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	653,260	1,558.06	1,017,822,521	1,619.28	1,057,813,792	0.92
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	273,511	3,059.93	836,926,702	3,748.02	1,025,125,792	0.89
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	12,187,620	79.12	964,296,682	83.92	1,022,804,571	0.89
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	各種金融	219,370	4,279.95	938,894,606	4,557.32	999,739,508	0.87
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	248,500	3,146.71	781,959,174	2,962.26	736,123,349	0.64
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	65,522	8,215.54	538,299,215	10,891.57	713,637,718	0.62

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	1,585,248	460.24	729,603,258	449.02	711,808,057	0.62
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	819,000	630.30	516,216,519	840.10	688,045,995	0.60
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	117,320	5,499.27	645,174,884	5,809.04	681,516,690	0.59
台湾	株式	MEDIA TEK INC	半導体・半導体製造装置	196,804	2,918.63	574,398,059	3,201.51	630,070,486	0.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	107,783	5,921.20	638,204,700	5,764.00	621,261,212	0.54
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	68,932	9,348.15	644,387,365	8,771.75	604,654,960	0.53
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	27,673	17,186.59	475,604,560	20,273.60	561,031,377	0.49
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	7,015,200	78.98	554,113,110	79.87	560,356,638	0.49
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	276,263	2,110.10	582,944,766	1,888.76	521,796,714	0.45
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6,847	77,342.40	529,563,413	75,246.40	515,212,101	0.45
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	258,430	1,708.65	441,568,487	1,950.46	504,058,928	0.44
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	10,228,200	46.93	480,103,526	49.07	501,926,413	0.44
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	281,900	1,426.84	402,227,605	1,745.10	491,945,663	0.43
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	7,043,515	64.00	450,841,308	68.98	485,906,743	0.42
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	3,513,640	142.85	501,941,449	134.62	473,012,569	0.41
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	104,076	4,292.35	446,731,295	4,503.11	468,666,093	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。

□. 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	4.95
		素材	8.64
		資本財	3.69
		商業・専門サービス	0.08
		運輸	2.05
		自動車・自動車部品	2.96
		耐久消費財・アパレル	1.49
		消費者サービス	1.15
		メディア・娯楽	5.87
		小売	7.02

	食品・生活必需品小売り	1.35
	食品・飲料・タバコ	3.70
	家庭用品・パーソナル用品	0.90
	ヘルスケア機器・サービス	1.00
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.86
	銀行	15.56
	各種金融	3.15
	保険	2.52
	不動産	1.89
	ソフトウェア・サービス	2.58
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.75
	電気通信サービス	3.12
	公益事業	2.95
	半導体・半導体製造装置	8.58
	小計	95.78
投資信託受益証券		0.23
投資証券		0.11
合計		96.13

(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	666	アメリカドル	30,075,488	4,176,583,018	31,838,130	4,421,361,113	3.85

(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	3,050,000.00	423,553,500	423,496,465	0.37
	トルコリラ	買建	16,500,000.00	122,925,000	122,760,000	0.11
	アメリカドル	売建	900,000.00	124,947,000	124,949,430	0.11

(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	タイ	8,979,209,593	10.32
	南アフリカ	8,910,117,530	10.24
	マレーシア	8,606,483,795	9.89
	メキシコ	8,408,010,721	9.66
	インドネシア	8,330,464,347	9.57
	中国	8,151,159,504	9.37
	ブラジル	7,878,940,751	9.06
	ポーランド	6,273,198,935	7.21
	チェコ	4,841,107,553	5.56
	コロンビア	3,237,400,605	3.72
	ルーマニア	3,003,490,260	3.45
	ハンガリー	2,692,983,108	3.10
	ペルー	2,101,773,832	2.42
	チリ	1,831,765,057	2.11
	ウルグアイ	129,833,646	0.15
	ドミニカ共和国	80,107,178	0.09
フィリピン	66,396,364	0.08	
	小計	83,522,442,779	95.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,488,289,344	4.01
合計(純資産総額)		87,010,732,123	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	104,100,000	2,286.65	2,380,402,877	2,281.57	2,375,122,868	0.000	2024/1/1	2.73
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	2.46	1,607,308,451	2.53	1,654,183,257	9.850	2027/6/28	1.90
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	189,400,000	860.10	1,629,038,492	865.26	1,638,806,077	10.500	2026/12/21	1.88
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	182,600,000	714.42	1,304,538,809	725.27	1,324,356,021	8.000	2030/1/31	1.52

ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	53,300,000	2,422.22	1,291,044,545	2,434.44	1,297,561,227	0.000	2023/7/1	1.49
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	641.59	1,124,722,314	643.96	1,128,874,963	5.750	2026/3/5	1.30
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	158,100,000	644.45	1,018,877,585	657.18	1,039,008,045	7.750	2031/5/29	1.19
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	158,200,000	636.82	1,007,453,543	645.20	1,020,711,209	8.750	2048/2/28	1.17
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000	2,465.75	1,015,890,317	2,396.78	987,475,221	10.000	2027/1/1	1.13
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	696.09	893,779,663	694.71	892,008,462	8.000	2024/9/5	1.03
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	112,000,000	687.64	770,160,384	697.19	780,862,387	8.250	2032/3/31	0.90
タイ	国債証券	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000	418.80	753,854,958	431.56	776,824,236	3.775	2032/6/25	0.89
タイ	国債証券	THAIGB 1.45% 12/17/24	197,000,000	390.28	768,867,951	390.41	769,123,441	1.450	2024/12/17	0.88
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000	667.75	761,235,191	673.47	767,755,971	7.500	2027/6/3	0.88
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	40,100,000,000	1.80	722,559,476	1.90	763,192,094	7.250	2034/10/18	0.88
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	110,000,000	683.84	752,224,704	693.41	762,753,552	8.875	2035/2/28	0.88
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	104,250,000	721.23	751,882,858	718.88	749,435,886	10.000	2024/12/5	0.86
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	116,000,000	638.38	740,531,750	645.93	749,287,430	8.750	2044/1/31	0.86
マレーシア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	27,300,000	2,675.99	730,546,473	2,742.13	748,601,676	2.632	2031/4/15	0.86
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	38,900,000	1,948.69	758,041,356	1,913.20	744,235,369	0.000	2025/7/1	0.86
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	113,700,000	646.71	735,312,271	654.09	743,708,789	8.500	2037/1/31	0.85
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	23,000,000	3,078.29	708,007,304	3,085.12	709,579,426	3.955	2025/9/15	0.82
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	100,100,000	683.87	684,553,988	694.86	695,557,169	8.500	2029/5/31	0.80
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	27,800,000	2,530.50	703,481,615	2,483.21	690,333,440	10.000	2025/1/1	0.79
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	159,500,000	415.28	662,376,545	426.98	681,043,691	3.650	2031/6/20	0.78
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	24,050,000	2,749.34	661,218,302	2,792.84	671,679,957	3.250	2025/7/25	0.77
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	100,300,000	661.79	663,777,697	667.85	669,858,766	9.000	2040/1/31	0.77
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000	645.85	634,880,065	675.52	664,044,493	8.500	2038/11/18	0.76
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 11/07/47	100,600,000	602.12	605,742,034	634.49	638,298,888	8.000	2047/11/7	0.73
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000	2,547.09	613,849,034	2,623.90	632,360,355	2.500	2026/7/25	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	95.99
合計	95.99

(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	128,896,327,800	96.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,082,351,676	3.07
合計(純資産総額)		132,978,679,476	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	4,073,960,000	3.06

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

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

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	13,661	641,965.1	8,769,885,231	640,000	8,743,040,000	6.57
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,711	602,039.34	7,050,482,710	609,000	7,131,999,000	5.36
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	37,870	168,508.07	6,381,400,610	172,500	6,532,575,000	4.91
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	59,087	107,796.46	6,369,369,432	110,100	6,505,478,700	4.89
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	19,189	314,169.82	6,028,604,675	337,500	6,476,287,500	4.87
日本	投資証券	G L P 投資法人	37,798	151,827.21	5,738,764,883	154,000	5,820,892,000	4.38

日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	17,652	302,540.51	5,340,445,082	307,500	5,427,990,000	4.08
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	23,334	189,590.13	4,423,896,093	193,500	4,515,129,000	3.40
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	26,196	154,388.3	4,044,355,906	154,200	4,039,423,200	3.04
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,709	337,066.72	3,946,714,224	344,000	4,027,896,000	3.03
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	8,009	390,476.65	3,127,327,489	393,000	3,147,537,000	2.37
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	35,190	80,002.28	2,815,280,233	80,500	2,832,795,000	2.13
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,765	74,396.48	2,809,583,067	74,700	2,821,045,500	2.12
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	17,500	156,224.2	2,733,923,500	159,100	2,784,250,000	2.09
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,183	433,463.43	2,680,104,387	427,000	2,640,141,000	1.99
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,044	621,102.5	2,511,738,510	627,000	2,535,588,000	1.91
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,896	321,057.12	2,535,067,019	320,500	2,530,668,000	1.90
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	51,544	45,407.61	2,340,489,849	47,650	2,456,071,600	1.85
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	14,336	163,031.38	2,337,217,863	161,300	2,312,396,800	1.74
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	4,626	493,598.51	2,283,386,707	499,500	2,310,687,000	1.74
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	6,814	336,012.98	2,289,592,445	337,500	2,299,725,000	1.73
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,345	517,057.31	2,246,614,011	529,000	2,298,505,000	1.73
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,771	159,718.35	2,199,481,397	161,500	2,224,016,500	1.67
日本	投資証券	イオンリート投資法人	12,963	161,083.21	2,088,121,651	159,600	2,068,894,800	1.56
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	16,228	116,322.14	1,887,675,687	118,000	1,914,904,000	1.44
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	10,957	171,594.05	1,880,156,005	172,400	1,888,986,800	1.42
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	4,023	448,049.46	1,802,502,977	440,500	1,772,131,500	1.33
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	8,399	210,134.32	1,764,918,153	208,900	1,754,551,100	1.32
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,448	311,057.45	1,694,640,987	315,500	1,718,844,000	1.29
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,852	210,491.22	1,652,777,059	215,600	1,692,891,200	1.27

(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	96.93
合計	96.93

(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	4,012,954,000	4,073,960,000	3.06
-------------	-------	------------	----	--------	---------------	---------------	------

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

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

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	65,370,988,507	77.32
	オーストラリア	5,611,040,327	6.64
	イギリス	3,841,151,269	4.54
	シンガポール	3,053,220,443	3.61
	カナダ	1,586,162,036	1.88
	フランス	1,425,936,358	1.69
	香港	1,057,715,326	1.25
	ベルギー	824,548,105	0.98
	スペイン	348,256,949	0.41
	ニュージーランド	318,539,627	0.38
	韓国	208,838,159	0.25
	ガーンジー	185,147,708	0.22
	オランダ	151,856,585	0.18
	イスラエル	144,448,154	0.17
	ドイツ	47,124,392	0.06
	アイルランド	34,734,874	0.04
	イタリア	15,791,854	0.02
	小計	84,225,500,673	99.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		323,829,813	0.38
	合計(純資産総額)	84,549,330,486	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		96,101,855	0.11

(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	438,106	15,113.59	6,621,354,528	15,804.79	6,924,175,387	8.19
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	43,123	83,096.94	3,583,389,772	93,176.21	4,018,037,928	4.75
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	74,848	39,544.49	2,959,826,650	40,355.62	3,020,537,595	3.57
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	293,179	8,782.07	2,574,720,744	8,651.60	2,536,467,730	3.00
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	155,196	15,684.86	2,434,228,952	16,311.67	2,531,505,968	2.99
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	457,020	4,378.98	2,001,282,866	4,675.75	2,136,912,590	2.53
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	219,852	9,235.17	2,030,370,974	9,609.80	2,112,734,629	2.50
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	136,362	13,499.68	1,840,843,877	15,102.11	2,059,354,265	2.44
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	66,487	22,087.87	1,468,556,233	23,717.60	1,576,912,557	1.87
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	70,522	19,837.18	1,398,958,091	21,180.45	1,493,687,864	1.77
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	160,783	8,293.72	1,333,490,508	8,829.35	1,419,610,121	1.68
オースト ラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	808,627	1,590.81	1,286,376,342	1,734.24	1,402,357,412	1.66
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	63,607	21,059.84	1,339,553,788	21,319.32	1,356,058,140	1.60
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	54,841	21,160.33	1,160,453,937	22,485.83	1,233,145,425	1.46
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	275,470	4,143.19	1,141,326,075	4,432.73	1,221,084,243	1.44
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	189,899	5,803.91	1,102,157,004	6,304.69	1,197,255,845	1.42
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	58,591	18,547.91	1,086,740,911	20,109.76	1,178,251,224	1.39
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	98,617	10,892.58	1,074,194,234	10,862.41	1,071,218,425	1.27
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	138,129	6,837.27	944,426,409	7,479.53	1,033,141,132	1.22
香港	投資証券	LINK REIT	1,000,200	886.78	886,962,417	935.22	935,415,046	1.11
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	295,175	2,887.64	852,361,045	3,155.12	931,314,435	1.10
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	30,952	28,808.16	891,670,196	29,786.22	921,943,276	1.09
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	257,562	3,320.55	855,250,048	3,560.62	917,082,160	1.08
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	341,290	2,335.99	797,250,959	2,591.31	884,389,623	1.05
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	121,437	6,953.82	844,451,106	7,161.52	869,674,221	1.03
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	50,642	15,207.80	770,153,849	16,351.94	828,095,072	0.98
アメリカ	投資証券	UDR INC	145,930	5,221.65	761,996,618	5,658.95	825,810,938	0.98
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	572,939	1,315.67	753,803,255	1,343.80	769,917,329	0.91
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	83,168	8,589.90	714,404,841	9,086.26	755,686,413	0.89
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	73,760	8,650.83	638,085,711	9,140.42	674,197,630	0.80

(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	99.62

合計	99.62
----	-------

(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	545,000.00	75,670,350	75,667,541	0.09
	ニュージーランドドル	買建	120,000.00	10,332,360	10,333,044	0.01
	シンガポールドル	買建	100,000.00	10,099,700	10,101,270	0.01

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

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

新興国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	南アフリカ	163,742,655	30.89
	メキシコ	133,082,764	25.10
	インド	61,917,673	11.68
	サウジアラビア	37,031,127	6.99
	タイ	33,855,731	6.39
	マレーシア	29,661,996	5.60
	トルコ	25,772,292	4.86
	フィリピン	19,366,857	3.65
	香港	4,663,160	0.88
		小計	509,094,255
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		21,027,652	3.97
合計(純資産総額)		530,121,907	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	投資 比率 (%)
メキシコ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	322,600	159.68	51,513,685	173.40	55,940,460	10.55
南アフリ カ	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	385,123	107.71	41,482,369	115.38	44,436,416	8.38
インド	投資証券	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	67,409	586.15	39,512,042	581.82	39,220,410	7.40
メキシコ	投資証券	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	65,700	339.66	22,315,667	422.71	27,772,400	5.24
南アフリ カ	投資証券	REDEFINE PROPERTIES LTD	742,157	33.53	24,890,165	32.88	24,405,685	4.60
メキシコ	投資証券	PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	85,800	198.82	17,059,371	200.41	17,195,697	3.24
南アフリ カ	投資証券	RESILIENT REIT LTD	38,132	418.68	15,965,471	434.92	16,584,674	3.13
メキシコ	投資証券	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	79,000	179.97	14,218,200	206.48	16,312,133	3.08
メキシコ	投資証券	CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	94,100	171.22	16,112,000	168.56	15,862,074	2.99
タイ	投資証券	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	208,500	72.70	15,158,993	72.31	15,077,052	2.84
インド	投資証券	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	24,792	622.91	15,443,403	572.26	14,187,683	2.68
南アフリ カ	投資証券	VUKILE PROPERTY FUND LTD	104,165	112.68	11,738,312	117.58	12,248,304	2.31
南アフリ カ	投資証券	FORTRESS REIT LTD-A	130,265	78.17	10,183,179	90.41	11,777,623	2.22
南アフリ カ	投資証券	EQUITES PROPERTY FUND LTD	85,446	134.06	11,455,643	134.72	11,511,422	2.17
トルコ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	206,442	33.15	6,843,792	52.07	10,750,137	2.03
南アフリ カ	投資証券	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	37,648	306.48	11,538,720	279.80	10,534,151	1.99
マレーシ ア	投資証券	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	209,000	44.33	9,266,468	44.64	9,330,819	1.76
サウジア ラビア	投資証券	JADWA REIT SAUDI FUND	19,699	490.63	9,665,058	469.97	9,258,108	1.75
マレーシ ア	投資証券	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	183,000	48.64	8,902,534	49.57	9,071,569	1.71
マレーシ ア	投資証券	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	153,200	56.65	8,679,247	56.03	8,584,907	1.62
インド	投資証券	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	17,151	535.58	9,185,888	496.15	8,509,580	1.61
タイ	投資証券	WHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	160,300	39.30	6,299,790	40.47	6,488,784	1.22
タイ	投資証券	FRASERS PROPERTY THAILAND IN	164,600	40.08	6,598,156	39.30	6,468,780	1.22
フィリピ ン	投資証券	AREIT INC	69,520	76.05	5,287,371	88.81	6,174,285	1.16
フィリピ ン	投資証券	RL COMMERCIAL REIT INC	404,000	12.26	4,955,868	14.59	5,897,483	1.11
南アフリ カ	投資証券	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	50,755	108.93	5,529,047	111.79	5,674,003	1.07
南アフリ カ	投資証券	INVESTEC PROPERTY FUND LTD	70,263	80.78	5,676,127	79.07	5,555,724	1.05
南アフリ カ	投資証券	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	275,044	17.62	4,847,815	18.68	5,139,582	0.97
サウジア ラビア	投資証券	RIYAD REIT FUND	13,266	416.85	5,530,025	377.75	5,011,279	0.95
南アフリ カ	投資証券	ATTACQ LTD	81,466	55.07	4,487,147	61.19	4,985,719	0.94

(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	96.03
合計	96.03

(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。

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：2014年11月28日
作成基準日：2022年11月30日



SMT インテックスシリーズ

基準価額・純資産の推移


※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 13,446円

純資産総額 26.98億円

分配の推移

（1万円当たり、税引前）

決算期	分配金
2020年10月	0円
2021年4月	0円
2021年10月	0円
2022年4月	0円
2022年10月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種別	業種	利率	償還期限	実効利率
外国株式インデックス マザーファンド	25.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア/ハードウェア機器	-	-	1.2%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.9%
外国債券インデックス マザーファンド	22.8%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.2%
		T 1.25% 09/30/28	アメリカ	国債	-	1.250%	2028/09/30	0.1%
グローバルREITインデックス マザーファンド	12.1%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	1.0%
新興国債券インデックス マザーファンド	11.5%	BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.3%
		COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	10.9%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.7%
		TENCENT HOLDINGS LTD	タイワン	株式	メディア/娯楽	-	-	0.4%
新興国REITインデックス マザーファンド	6.9%	FERRUNO ADMINISTRACION SA	メキシコ	投資証券	-	-	-	0.7%
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	東アフリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
国内株式インデックス マザーファンド	4.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
		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	3.1%	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%
J-REITインデックス マザーファンド	2.1%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.1%
		リソルティアREIT投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.1%

※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)


※2014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】

無期限とします。（2014年11月28日設定）

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

(4) 【計算期間】

原則として、毎年4月21日から10月20日まで及び10月21日から翌年4月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2014年11月28日から2015年4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30億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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、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16期計算期間(2022年4月21日から2022年10月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【SMT インデックスバランス・オープン】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (2022年4月20日現在)	第16期 (2022年10月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,380,332	32,345,151
親投資信託受益証券	2,766,075,688	2,658,197,016
未収入金	840,000	3,530,000
流動資産合計	2,801,296,020	2,694,072,167
資産合計	2,801,296,020	2,694,072,167
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,054,113	2,231,801
未払受託者報酬	731,180	739,049
未払委託者報酬	6,580,565	6,651,317
未払利息	26	62
その他未払費用	73,054	73,840
流動負債合計	8,438,938	9,696,069
負債合計	8,438,938	9,696,069
純資産の部		
元本等		
元本	2,000,653,523	2,014,280,501
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	792,203,559	670,095,597
(分配準備積立金)	767,331,118	771,147,151
元本等合計	2,792,857,082	2,684,376,098
純資産合計	2,792,857,082	2,684,376,098
負債純資産合計	2,801,296,020	2,694,072,167

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	2021年10月21日	自	2022年 4月21日
	至	2022年 4月20日	至	2022年10月20日
営業収益				
受取利息		87		52
有価証券売買等損益		134,764,777		117,818,672
営業収益合計		134,764,864		117,818,620
営業費用				
支払利息		5,592		5,702
受託者報酬		731,180		739,049
委託者報酬		6,580,565		6,651,317
その他費用		73,054		73,840
営業費用合計		7,390,391		7,469,908
営業利益又は営業損失（ ）		127,374,473		125,288,528
経常利益又は経常損失（ ）		127,374,473		125,288,528
当期純利益又は当期純損失（ ）		127,374,473		125,288,528
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,443,525		3,248,926
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		685,446,701		792,203,559
剰余金増加額又は欠損金減少額		27,303,361		30,435,503
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		27,303,361		30,435,503
剰余金減少額又は欠損金増加額		49,364,501		30,503,863
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		49,364,501		30,503,863
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		792,203,559		670,095,597

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2022年 4月20日現在)	第16期 (2022年10月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,000,653,523口	2,014,280,501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) 1.3960円 (13,960円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3327円 (13,327円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 2021年10月21日 至 2022年 4月20日			第16期 自 2022年 4月21日 至 2022年10月20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	31,507,303円	費用控除後の配当等収益額	A	32,835,155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	97,310,695円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	220,176,500円	収益調整金額	C	256,179,478円
分配準備積立金額	D	638,513,120円	分配準備積立金額	D	738,311,996円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	987,507,618円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,027,326,629円
当ファンドの期末残存口数	F	2,000,653,523口	当ファンドの期末残存口数	F	2,014,280,501口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,935円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,100円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第16期 自 2022年 4月21日 至 2022年10月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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16期 (2022年10月20日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 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15期	第16期
	自 2021年10月21日 至 2022年 4月20日	自 2022年 4月21日 至 2022年10月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,064,448,920円	2,000,653,523円
期中追加設定元本額	85,522,955円	91,167,976円
期中一部解約元本額	149,318,352円	77,540,998円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第15期	第16期
	(2022年 4月20日現在)	(2022年10月20日現在)
	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	134,733,812	115,082,025
合計	134,733,812	115,082,025

（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 - R E I Tインデックス マザーファンド	26,526,688	54,642,324	
	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	133,468,432	317,027,566	
	新興国株式インデックス マザーファンド	84,001,103	288,778,991	

国内株式インデックス マザーファンド	58,293,720	110,460,770	
外国株式インデックス マザーファンド	157,107,314	682,112,825	
国内債券インデックス マザーファンド	61,794,077	83,440,542	
外国債券インデックス マザーファンド	198,140,899	629,850,289	
新興国債券インデックス マザーファンド	169,623,984	310,157,454	
新興国REITインデックス マザーファンド	241,785,864	181,726,255	
合計	1,130,742,081	2,658,197,016	

(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10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,317,735,805
株式	486,014,972,030
派生商品評価勘定	178,323,250
未収入金	6,000,000
未収配当金	5,175,074,743
差入委託証拠金	309,405,500
流動資産合計	494,001,511,328
資産合計	494,001,511,328
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,069,950
前受金	166,294,000
未払金	352,150
未払解約金	152,508,978
未払利息	4,491
流動負債合計	331,229,569
負債合計	331,229,569
純資産の部	
元本等	
元本	260,523,199,853

	2022年10月20日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	233,147,081,906
元本等合計	493,670,281,759
純資産合計	493,670,281,759
負債純資産合計	494,001,511,328

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2022年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	260,523,199,853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 1.8949円 (1万口当たり純資産額) (18,949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10月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 4月21日
期首元本額	259,034,900,279円
期中追加設定元本額	14,270,132,575円
期中一部解約元本額	12,781,833,001円
期末元本額	260,523,199,853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）	391,704,267円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,057,410,484円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,636,639円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,729,900,169円
世界経済インデックスファンド	4,276,104,244円
日本株式インデックス・オープン	3,253,466,673円
D C マイセレクション 2 5	6,230,027,914円
D C マイセレクション 5 0	19,094,577,917円
D C マイセレクション 7 5	19,300,061,466円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,259,610,449円
D C マイセレクション S 2 5	3,228,793,579円
D C マイセレクション S 5 0	9,509,351,816円
D C マイセレクション S 7 5	7,340,629,972円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,579,689,121円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	162,007,337円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	688,610,865円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	512,173,547円
D C 世界経済インデックスファンド	3,775,805,733円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,529,161,104円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,252,015円

区分	2022年10月20日現在
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	17,671,882円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,793,533円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	170,759,969円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	26,488,931円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	101,340,646円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	24,888,008円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	67,120,862円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	820,512,772円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	422,753,916円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,726,696,889円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	42,417,958円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	17,383,436円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	459,316,633円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	258,437,223円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	334,011,944円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	34,287,196円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	579,309,582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	1,897,540,526円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,804,602,573円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,887,898,315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	6,193,390,222円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	516,719,405円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	442,540,557円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,663,038,200円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	222,910,055円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,873,507円
SMT インデックスバランス・オープン	58,293,720円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	27,608,703,820円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	543,187,894円
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,111,437円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	199,041,019円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	35,305,802円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,585,667円
グローバル経済コア	221,899,073円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	29,582,632円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	277,144,401円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,047,628円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	229,509,722円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	19,983,685円

区分	2022年10月20日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	17,205,402円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	6,707,976円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	8,316,024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）	44,988,016,773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）	821,106,421円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	328,231,251円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	54,819,627円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	344,810,974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）	45,716,326,950円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	18,032,904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）	201,848,236円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		6,778,144,706
合計		6,778,144,706

(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10月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	7,424,636,000	-	7,590,930,000	166,294,000
合計		7,424,636,000	-	7,590,930,000	166,294,000

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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	3,695.00	32,885,500	
日本水産	253,000	540.00	136,620,000	
マルハニチロ	36,100	2,389.00	86,242,900	
雪国まいたけ	19,900	1,060.00	21,094,000	
カネコ種苗	7,700	1,400.00	10,780,000	
サカタのタネ	29,500	4,600.00	135,700,000	
ホクト	20,800	1,908.00	39,686,400	
ホクリヨウ	3,700	612.00	2,264,400	
住石ホールディングス	47,700	222.00	10,589,400	
日鉄鉱業	10,400	2,937.00	30,544,800	
三井松島ホールディングス	11,400	3,070.00	34,998,000	
I N P E X	863,900	1,483.00	1,281,163,700	
石油資源開発	32,000	3,720.00	119,040,000	
K & O エナジーグループ	10,600	1,917.00	20,320,200	
ショーボンドホールディングス	31,800	6,400.00	203,520,000	
ミライト・ワン	87,700	1,444.00	126,638,800	
タマホーム	16,500	2,270.00	37,455,000	
サンヨーホームズ	3,100	702.00	2,176,200	
日本アクア	10,800	717.00	7,743,600	
ファーストコーポレーション	6,700	712.00	4,770,400	
ベステラ	5,600	898.00	5,028,800	
Robot Home	39,700	172.00	6,828,400	
キャンディル	4,000	493.00	1,972,000	
ダイセキ環境ソリューション	5,200	818.00	4,253,600	
第一カッター興業	6,000	1,216.00	7,296,000	
安藤・間	124,000	843.00	104,532,000	
東急建設	73,200	640.00	46,848,000	
コムシスホールディングス	87,800	2,460.00	215,988,000	
ビーアールホールディングス	34,200	344.00	11,764,800	
高松コンストラクショングループ	17,400	1,914.00	33,303,600	
東建コーポレーション	7,600	7,960.00	60,496,000	
ソネック	2,800	938.00	2,626,400	
ヤマウラ	11,800	970.00	11,446,000	
オリエンタル白石	91,600	257.00	23,541,200	
大成建設	175,100	4,030.00	705,653,000	
大林組	584,300	964.00	563,265,200	
清水建設	540,300	743.00	401,442,900	

飛島建設	16,800	1,060.00	17,808,000
長谷工コーポレーション	168,600	1,557.00	262,510,200
松井建設	21,000	560.00	11,760,000
銭高組	2,300	2,807.00	6,456,100
鹿島建設	428,100	1,394.00	596,771,400
不動テトラ	13,400	1,480.00	19,832,000
大末建設	6,600	1,462.00	9,649,200
鉄建建設	12,700	1,785.00	22,669,500
西松建設	38,100	3,775.00	143,827,500
三井住友建設	141,900	441.00	62,577,900
大豊建設	9,200	4,180.00	38,456,000
佐田建設	13,500	398.00	5,373,000
ナカノフドー建設	15,000	300.00	4,500,000
奥村組	31,300	2,841.00	88,923,300
東鉄工業	24,700	2,474.00	61,107,800
イチケン	4,500	1,802.00	8,109,000
富士ピー・エス	8,100	452.00	3,661,200
浅沼組	14,100	2,828.00	39,874,800
戸田建設	241,200	753.00	181,623,600
熊谷組	31,100	2,549.00	79,273,900
北野建設	3,800	2,405.00	9,139,000
植木組	5,100	1,287.00	6,563,700
矢作建設工業	25,000	749.00	18,725,000
ピーエス三菱	20,700	612.00	12,668,400
日本ハウスホールディングス	32,400	451.00	14,612,400
新日本建設	26,800	726.00	19,456,800
東亜道路工業	3,300	6,000.00	19,800,000
日本道路	5,500	5,850.00	32,175,000
東亜建設工業	14,000	2,408.00	33,712,000
日本国土開発	49,000	583.00	28,567,000
若築建設	9,700	2,360.00	22,892,000
東洋建設	70,500	903.00	63,661,500
五洋建設	231,600	731.00	169,299,600
世紀東急工業	28,700	800.00	22,960,000
福田組	6,200	4,880.00	30,256,000
住友林業	125,400	2,280.00	285,912,000
日本基礎技術	15,400	419.00	6,452,600
巴コーポレーション	22,900	350.00	8,015,000
大和ハウス工業	498,000	2,982.50	1,485,285,000
ライト工業	34,600	2,001.00	69,234,600
積水ハウス	597,200	2,444.00	1,459,556,800
日特建設	13,000	895.00	11,635,000

北陸電気工事	11,200	690.00	7,728,000	
ユアテック	36,000	718.00	25,848,000	
日本リーテック	12,000	790.00	9,480,000	
四電工	6,100	1,814.00	11,065,400	
中電工	25,400	2,102.00	53,390,800	
関電工	102,300	831.00	85,011,300	
きんでん	127,800	1,513.00	193,361,400	
東京エネシス	18,600	942.00	17,521,200	
トーエネック	6,300	3,525.00	22,207,500	
住友電設	15,500	2,638.00	40,889,000	
日本電設工業	26,800	1,786.00	47,864,800	
エクシオグループ	87,300	2,195.00	191,623,500	
新日本空調	13,600	1,832.00	24,915,200	
九電工	39,700	2,928.00	116,241,600	
三機工業	39,900	1,608.00	64,159,200	
日揮ホールディングス	177,700	1,722.00	305,999,400	
中外炉工業	5,800	1,592.00	9,233,600	
ヤマト	15,100	699.00	10,554,900	
太平電業	11,400	3,225.00	36,765,000	
高砂熱学工業	48,100	1,790.00	86,099,000	
三晃金属工業	2,500	2,614.00	6,535,000	
朝日工業社	7,600	2,000.00	15,200,000	
明星工業	31,600	693.00	21,898,800	
大気社	26,200	3,440.00	90,128,000	
ダイダン	11,800	2,134.00	25,181,200	
日比谷総合設備	17,100	1,885.00	32,233,500	
フィル・カンパニー	2,900	1,031.00	2,989,900	
テスホールディングス	17,600	956.00	16,825,600	
インフロニア・ホールディングス	219,100	1,020.00	223,482,000	
東洋エンジニアリング	26,400	577.00	15,232,800	
レイズネクスト	27,000	1,223.00	33,021,000	
ニッポン	49,100	1,573.00	77,234,300	
日清製粉グループ本社	189,600	1,575.00	298,620,000	
日東富士製粉	2,900	4,480.00	12,992,000	
昭和産業	15,900	2,507.00	39,861,300	
鳥越製粉	14,600	620.00	9,052,000	
中部飼料	20,800	1,024.00	21,299,200	
フィード・ワン	24,000	677.00	16,248,000	
東洋精糖	3,400	857.00	2,913,800	
日本甜菜製糖	10,500	1,639.00	17,209,500	
D M三井製糖ホールディングス	16,300	1,898.00	30,937,400	
塩水港精糖	24,000	197.00	4,728,000	

日新製糖	9,500	1,714.00	16,283,000
森永製菓	40,500	3,835.00	155,317,500
中村屋	4,100	3,115.00	12,771,500
江崎グリコ	46,900	3,390.00	158,991,000
名糖産業	7,300	1,639.00	11,964,700
井村屋グループ	9,800	2,239.00	21,942,200
不二家	11,200	2,536.00	28,403,200
山崎製パン	109,800	1,633.00	179,303,400
第一屋製パン	3,500	408.00	1,428,000
モロゾフ	5,700	3,780.00	21,546,000
亀田製菓	10,400	4,560.00	47,424,000
寿スピリッツ	17,400	8,240.00	143,376,000
カルビー	91,800	3,040.00	279,072,000
森永乳業	32,800	4,205.00	137,924,000
六甲バター	12,000	1,406.00	16,872,000
ヤクルト本社	127,900	8,310.00	1,062,849,000
明治ホールディングス	110,900	6,250.00	693,125,000
雪印メグミルク	44,100	1,669.00	73,602,900
プリマハム	25,200	2,040.00	51,408,000
日本ハム	70,600	3,625.00	255,925,000
林兼産業	6,100	441.00	2,690,100
丸大食品	18,200	1,416.00	25,771,200
S Foods	18,100	2,743.00	49,648,300
柿安本店	7,000	2,238.00	15,666,000
伊藤ハム米久ホールディングス	127,500	671.00	85,552,500
サッポロホールディングス	54,000	3,310.00	178,740,000
アサヒグループホールディングス	379,000	4,277.00	1,620,983,000
キリンホールディングス	740,200	2,201.00	1,629,180,200
宝ホールディングス	112,000	1,056.00	118,272,000
オエノンホールディングス	49,000	288.00	14,112,000
養命酒製造	5,400	1,835.00	9,909,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	128,500	1,369.00	175,916,500
サントリー食品インターナショナル	115,500	5,040.00	582,120,000
ダイドーグループホールディングス	10,300	4,660.00	47,998,000
伊藤園	61,100	5,280.00	322,608,000
キーコーヒー	18,400	2,118.00	38,971,200
ユニカフェ	6,000	945.00	5,670,000
ジャパンフーズ	2,900	1,058.00	3,068,200
日清オイリオグループ	23,100	3,200.00	73,920,000
不二製油グループ本社	43,600	2,335.00	101,806,000
かどや製油	1,800	3,600.00	6,480,000
J - オイルミルズ	18,800	1,553.00	29,196,400

キッコーマン	120,800	8,200.00	990,560,000
味の素	401,400	4,091.00	1,642,127,400
ブルドックソース	7,200	1,755.00	12,636,000
キューピー	88,200	2,403.00	211,944,600
ハウス食品グループ本社	62,800	2,792.00	175,337,600
カゴメ	76,400	2,999.00	229,123,600
焼津水産化学工業	8,100	830.00	6,723,000
アリアケジャパン	18,400	4,985.00	91,724,000
ピエトロ	2,600	1,780.00	4,628,000
エバラ食品工業	4,400	3,200.00	14,080,000
やまみ	1,700	1,343.00	2,283,100
ニチレイ	75,100	2,285.00	171,603,500
東洋水産	89,800	6,050.00	543,290,000
イトアンドホールディングス	7,600	2,176.00	16,537,600
大冷	2,200	1,855.00	4,081,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,400	470.00	4,888,000
日清食品ホールディングス	64,900	9,650.00	626,285,000
永谷園ホールディングス	8,900	1,991.00	17,719,900
一正蒲鉾	7,800	749.00	5,842,200
フジッコ	18,700	1,917.00	35,847,900
ロック・フィールド	20,000	1,460.00	29,200,000
日本たばこ産業	1,079,800	2,435.50	2,629,852,900
ケンコーマヨネーズ	10,300	1,693.00	17,437,900
わらべや日洋ホールディングス	12,100	1,905.00	23,050,500
なとり	11,200	2,055.00	23,016,000
イフジ産業	3,500	875.00	3,062,500
ファーマフーズ	25,400	1,251.00	31,775,400
ユーグレナ	105,600	861.00	90,921,600
紀文食品	15,600	901.00	14,055,600
ピクルスホールディングス	9,600	987.00	9,475,200
ミヨシ油脂	6,400	985.00	6,304,000
理研ビタミン	14,200	1,853.00	26,312,600
片倉工業	15,600	2,061.00	32,151,600
ゲンゼ	11,500	3,820.00	43,930,000
東洋紡	78,200	1,031.00	80,624,200
ユニチカ	55,900	268.00	14,981,200
富士紡ホールディングス	8,200	3,370.00	27,634,000
倉敷紡績	14,000	2,088.00	29,232,000
シキボウ	10,300	855.00	8,806,500
日本毛織	49,000	998.00	48,902,000
トーア紡コーポレーション	7,200	348.00	2,505,600
帝国繊維	19,100	1,596.00	30,483,600

帝人	173,000	1,383.00	239,259,000
東レ	1,220,400	722.50	881,739,000
住江織物	3,400	1,760.00	5,984,000
日本フェルト	12,400	400.00	4,960,000
イチカワ	2,700	1,310.00	3,537,000
日東製網	2,100	1,329.00	2,790,900
アツギ	14,600	374.00	5,460,400
ダイニック	6,400	574.00	3,673,600
セーレン	36,500	2,294.00	83,731,000
ソトー	7,400	785.00	5,809,000
東海染工	2,400	1,121.00	2,690,400
小松マテーレ	29,900	766.00	22,903,400
ワコールホールディングス	40,300	2,360.00	95,108,000
ホギメディカル	24,500	3,325.00	81,462,500
T S Iホールディングス	60,100	431.00	25,903,100
マツオカコーポレーション	5,900	935.00	5,516,500
ワールド	25,900	1,414.00	36,622,600
三陽商会	8,700	1,104.00	9,604,800
ナイガイ	7,500	256.00	1,920,000
オンワードホールディングス	108,900	315.00	34,303,500
ルックホールディングス	5,400	2,037.00	10,999,800
ゴールドウイン	32,500	7,760.00	252,200,000
デサント	33,600	3,750.00	126,000,000
キング	9,800	432.00	4,233,600
ヤマトインターナショナル	15,500	250.00	3,875,000
特種東海製紙	10,200	2,914.00	29,722,800
王子ホールディングス	758,300	534.00	404,932,200
日本製紙	79,700	897.00	71,490,900
三菱製紙	25,100	276.00	6,927,600
北越コーポレーション	117,200	794.00	93,056,800
中越パルプ工業	7,500	933.00	6,997,500
巴川製紙所	5,800	743.00	4,309,400
大王製紙	84,200	1,160.00	97,672,000
阿波製紙	4,400	301.00	1,324,400
レンゴー	152,000	841.00	127,832,000
トモク	9,600	1,461.00	14,025,600
ザ・バック	12,400	2,360.00	29,264,000
北の達人コーポレーション	70,300	272.00	19,121,600
クラレ	265,300	1,023.00	271,401,900
旭化成	1,215,700	949.90	1,154,793,430
共和レザー	10,700	527.00	5,638,900
昭和電工	161,300	2,122.00	342,278,600

住友化学	1,340,600	505.00	677,003,000	
住友精化	7,800	3,015.00	23,517,000	
日産化学	88,000	6,700.00	589,600,000	
ラサ工業	6,900	2,111.00	14,565,900	
クレハ	14,300	9,130.00	130,559,000	
多木化学	6,500	5,130.00	33,345,000	
テイカ	11,200	1,324.00	14,828,800	
石原産業	35,200	1,028.00	36,185,600	
片倉コープアグリ	4,400	1,158.00	5,095,200	
日本曹達	21,500	4,515.00	97,072,500	
東ソー	243,000	1,621.00	393,903,000	
トクヤマ	58,400	1,753.00	102,375,200	
セントラル硝子	29,500	3,345.00	98,677,500	
東亜合成	85,800	1,133.00	97,211,400	
大阪ソーダ	15,000	3,665.00	54,975,000	
関東電化工業	35,800	931.00	33,329,800	
デンカ	66,200	3,200.00	211,840,000	
信越化学工業	311,500	14,935.00	4,652,252,500	
日本カーバイド工業	7,000	1,239.00	8,673,000	
堺化学工業	12,700	1,948.00	24,739,600	
第一稀元素化学工業	16,700	1,268.00	21,175,600	
エア・ウォーター	157,400	1,648.00	259,395,200	
日本酸素ホールディングス	161,900	2,333.00	377,712,700	
日本化学工業	5,600	1,883.00	10,544,800	
東邦アセチレン	3,900	1,069.00	4,169,100	
日本パーカラライジング	82,600	950.00	78,470,000	
高压ガス工業	27,700	627.00	17,367,900	
チタン工業	2,300	1,565.00	3,599,500	
四国化成工業	22,700	1,273.00	28,897,100	
戸田工業	4,200	2,835.00	11,907,000	
ステラ ケミファ	9,900	2,655.00	26,284,500	
保土谷化学工業	5,200	2,853.00	14,835,600	
日本触媒	28,000	5,300.00	148,400,000	
大日精化工業	13,900	1,745.00	24,255,500	
カネカ	42,400	3,670.00	155,608,000	
三菱瓦斯化学	152,300	1,886.00	287,237,800	
三井化学	153,000	2,777.00	424,881,000	
J S R	168,800	2,717.00	458,629,600	
東京応化工業	29,200	6,110.00	178,412,000	
大阪有機化学工業	12,600	1,948.00	24,544,800	
三菱ケミカルグループ	1,219,900	668.30	815,259,170	
K Hネオケム	27,800	2,721.00	75,643,800	

ダイセル	264,200	843.00	222,720,600
住友ベークライト	27,800	4,040.00	112,312,000
積水化学工業	375,400	1,777.00	667,085,800
日本ゼオン	143,000	1,313.00	187,759,000
アイカ工業	46,300	3,185.00	147,465,500
UBE	92,600	1,940.00	179,644,000
積水樹脂	27,000	1,687.00	45,549,000
タキロンシーアイ	42,500	520.00	22,100,000
旭有機材	11,100	2,304.00	25,574,400
ニチバン	10,300	1,688.00	17,386,400
リケンテクノス	39,900	524.00	20,907,600
大倉工業	7,700	1,864.00	14,352,800
積水化成成品工業	23,400	389.00	9,102,600
群栄化学工業	3,900	2,406.00	9,383,400
タイガースポリマー	9,400	396.00	3,722,400
ミライアル	6,300	1,524.00	9,601,200
ダイキアクシス	6,800	662.00	4,501,600
ダイキョーニシカワ	41,400	589.00	24,384,600
竹本容器	6,200	743.00	4,606,600
森六ホールディングス	9,500	1,739.00	16,520,500
恵和	5,400	3,555.00	19,197,000
日本化薬	138,100	1,160.00	160,196,000
カーリットホールディングス	16,500	692.00	11,418,000
日本精化	12,600	1,971.00	24,834,600
扶桑化学工業	15,500	3,125.00	48,437,500
トリケミカル研究所	20,200	1,970.00	39,794,000
ADEKA	77,600	2,140.00	166,064,000
日油	56,800	5,210.00	295,928,000
新日本理化	27,900	280.00	7,812,000
ハリマ化成グループ	13,000	867.00	11,271,000
花王	414,300	5,706.00	2,363,995,800
第一工業製薬	6,700	1,942.00	13,011,400
石原ケミカル	9,100	1,247.00	11,347,700
日華化学	7,400	848.00	6,275,200
ニイタカ	3,700	2,091.00	7,736,700
三洋化成工業	11,700	4,215.00	49,315,500
有機合成薬品工業	13,700	313.00	4,288,100
大日本塗料	22,200	724.00	16,072,800
日本ペイントホールディングス	738,400	969.00	715,509,600
関西ペイント	169,800	2,113.00	358,787,400
神東塗料	15,400	133.00	2,048,200
中国塗料	42,500	914.00	38,845,000

日本特殊塗料	11,800	855.00	10,089,000
藤倉化成	24,500	404.00	9,898,000
太陽ホールディングス	28,900	2,491.00	71,989,900
D I C	65,200	2,436.00	158,827,200
サカティンクス	37,100	1,048.00	38,880,800
東洋インキS Cホールディングス	32,700	1,913.00	62,555,100
T & K T O K A	15,900	937.00	14,898,300
富士フィルムホールディングス	352,700	6,812.00	2,402,592,400
資生堂	348,900	5,196.00	1,812,884,400
ライオン	200,500	1,584.00	317,592,000
高砂香料工業	11,300	2,819.00	31,854,700
マンダム	39,100	1,502.00	58,728,200
ミルボン	24,800	6,040.00	149,792,000
ファンケル	81,200	2,872.00	233,206,400
コーセー	34,000	15,510.00	527,340,000
コタ	14,000	1,573.00	22,022,000
シーボン	2,600	1,640.00	4,264,000
ポーラ・オルビスホールディングス	85,600	1,657.00	141,839,200
ノエビアホールディングス	14,900	5,550.00	82,695,000
アジュバンホールディングス	4,500	933.00	4,198,500
新日本製薬	9,500	1,479.00	14,050,500
エステー	12,900	1,537.00	19,827,300
アグロ カネショウ	6,700	1,320.00	8,844,000
コニシ	30,400	1,691.00	51,406,400
長谷川香料	34,600	3,135.00	108,471,000
星光P M C	9,400	524.00	4,925,600
小林製薬	51,100	7,950.00	406,245,000
荒川化学工業	14,200	1,014.00	14,398,800
メック	13,800	2,307.00	31,836,600
日本高純度化学	4,700	2,467.00	11,594,900
タカラバイオ	52,500	1,673.00	87,832,500
J C U	20,600	2,806.00	57,803,600
新田ゼラチン	11,400	1,026.00	11,696,400
O A T アグリオ	7,600	1,749.00	13,292,400
デクセリアルズ	52,300	3,240.00	169,452,000
アース製薬	15,100	5,170.00	78,067,000
北興化学工業	16,800	927.00	15,573,600
大成ラミック	5,300	3,025.00	16,032,500
クミアイ化学工業	66,400	972.00	64,540,800
日本農薬	35,700	878.00	31,344,600
アキレス	12,800	1,380.00	17,664,000
有沢製作所	27,300	1,277.00	34,862,100

日東電工	121,300	7,970.00	966,761,000
レック	23,800	836.00	19,896,800
三光合成	22,900	470.00	10,763,000
きもと	30,700	240.00	7,368,000
藤森工業	15,600	3,100.00	48,360,000
前澤化成工業	11,800	1,340.00	15,812,000
未来工業	7,200	1,462.00	10,526,400
ウェーブロックホールディングス	7,600	579.00	4,400,400
J S P	11,700	1,455.00	17,023,500
エフピコ	36,900	3,670.00	135,423,000
天馬	15,800	2,047.00	32,342,600
信越ポリマー	36,000	1,261.00	45,396,000
東リ	45,800	190.00	8,702,000
ニフコ	67,000	3,150.00	211,050,000
バルカー	16,300	2,577.00	42,005,100
ユニ・チャーム	348,100	4,637.00	1,614,139,700
ショーエイコーポレーション	5,400	578.00	3,121,200
協和キリン	201,800	3,360.00	678,048,000
武田薬品工業	1,577,100	3,768.00	5,942,512,800
アステラス製薬	1,715,500	2,005.50	3,440,435,250
住友ファーマ	123,900	1,041.00	128,979,900
塩野義製薬	232,900	6,848.00	1,594,899,200
わかもと製薬	19,500	232.00	4,524,000
日本新薬	43,800	7,510.00	328,938,000
中外製薬	523,000	3,604.00	1,884,892,000
科研製薬	28,600	3,800.00	108,680,000
エーザイ	221,700	8,262.00	1,831,685,400
ロート製薬	95,600	4,645.00	444,062,000
小野薬品工業	386,800	3,445.00	1,332,526,000
久光製薬	42,400	3,635.00	154,124,000
持田製薬	22,500	3,450.00	77,625,000
参天製薬	349,500	980.00	342,510,000
扶桑薬品工業	6,500	2,014.00	13,091,000
日本ケミファ	2,100	1,710.00	3,591,000
ツムラ	57,400	3,080.00	176,792,000
日医工	57,200	462.00	26,426,400
キッセイ薬品工業	29,000	2,598.00	75,342,000
生化学工業	35,400	889.00	31,470,600
栄研化学	29,800	1,806.00	53,818,800
鳥居薬品	9,000	2,949.00	26,541,000
J C R ファーマ	56,600	1,998.00	113,086,800
東和薬品	28,900	2,175.00	62,857,500

富士製薬工業	10,800	1,039.00	11,221,200
ゼリア新薬工業	29,800	2,134.00	63,593,200
第一三共	1,455,500	4,423.00	6,437,676,500
キョーリン製薬ホールディングス	36,200	1,788.00	64,725,600
大幸薬品	30,200	554.00	16,730,800
ダイト	12,600	2,469.00	31,109,400
大塚ホールディングス	382,300	4,654.00	1,779,224,200
大正製薬ホールディングス	37,100	5,300.00	196,630,000
ペプチドリーム	81,000	1,607.00	130,167,000
あすか製薬ホールディングス	19,000	1,146.00	21,774,000
サワイグループホールディングス	38,500	4,230.00	162,855,000
日本コークス工業	169,500	86.00	14,577,000
ニチレキ	21,700	1,324.00	28,730,800
ユシロ化学工業	9,500	835.00	7,932,500
ビーピー・カストロール	7,200	989.00	7,120,800
富士石油	43,800	303.00	13,271,400
MORESCO	6,600	1,028.00	6,784,800
出光興産	204,100	3,280.00	669,448,000
ENEOSホールディングス	3,018,600	481.50	1,453,455,900
コスモエネルギーホールディングス	79,200	3,820.00	302,544,000
横浜ゴム	95,100	2,296.00	218,349,600
TOYO TIRE	96,000	1,656.00	158,976,000
ブリヂストン	533,500	5,083.00	2,711,780,500
住友ゴム工業	163,900	1,242.00	203,563,800
藤倉コンポジット	16,100	842.00	13,556,200
オカモト	9,300	3,645.00	33,898,500
フコク	8,800	1,000.00	8,800,000
ニッタ	18,900	2,854.00	53,940,600
住友理工	38,900	576.00	22,406,400
三ツ星ベルト	24,400	3,080.00	75,152,000
バンドー化学	32,400	1,042.00	33,760,800
日東紡績	24,900	2,221.00	55,302,900
AGC	170,100	4,540.00	772,254,000
日本板硝子	90,700	542.00	49,159,400
石塚硝子	3,200	1,511.00	4,835,200
日本山村硝子	7,100	565.00	4,011,500
日本電気硝子	68,200	2,529.00	172,477,800
オハラ	8,000	1,168.00	9,344,000
住友大阪セメント	30,000	3,195.00	95,850,000
太平洋セメント	114,000	2,014.00	229,596,000
日本ヒューム	16,600	634.00	10,524,400
日本コンクリート工業	36,400	247.00	8,990,800

三谷セキサン	8,200	3,455.00	28,331,000
アジアパイルホールディングス	28,700	503.00	14,436,100
東海カーボン	140,200	940.00	131,788,000
日本カーボン	9,600	4,135.00	39,696,000
東洋炭素	10,500	3,540.00	37,170,000
ノリタケカンパニーリミテド	10,200	4,050.00	41,310,000
TOTO	121,300	4,635.00	562,225,500
日本碍子	197,700	1,848.00	365,349,600
日本特殊陶業	140,000	2,692.00	376,880,000
MARUWA	6,900	15,710.00	108,399,000
品川リフラクトリーズ	4,700	3,925.00	18,447,500
黒崎播磨	3,400	4,655.00	15,827,000
ヨータイ	12,800	1,397.00	17,881,600
東京窯業	20,200	254.00	5,130,800
ニッカトー	8,600	412.00	3,543,200
フジインコーポレーテッド	15,000	6,100.00	91,500,000
クニミネ工業	6,400	729.00	4,665,600
エーアンドエーマテリアル	3,500	854.00	2,989,000
ニチアス	42,300	2,256.00	95,428,800
ニチハ	25,600	2,722.00	69,683,200
日本製鉄	828,900	2,117.50	1,755,195,750
神戸製鋼所	345,800	608.00	210,246,400
中山製鋼所	27,600	641.00	17,691,600
合同製鐵	9,700	1,757.00	17,042,900
JFEホールディングス	459,400	1,407.00	646,375,800
東京製鐵	58,000	1,317.00	76,386,000
共英製鋼	19,600	1,444.00	28,302,400
大和工業	32,400	4,455.00	144,342,000
東京鐵鋼	8,200	1,350.00	11,070,000
大阪製鐵	10,600	1,068.00	11,320,800
淀川製鋼所	21,700	2,415.00	52,405,500
丸一鋼管	57,600	2,914.00	167,846,400
モリ工業	4,900	2,518.00	12,338,200
大同特殊鋼	27,100	3,590.00	97,289,000
日本高周波鋼業	7,500	307.00	2,302,500
日本冶金工業	13,500	2,813.00	37,975,500
山陽特殊製鋼	17,000	1,902.00	32,334,000
愛知製鋼	11,200	2,101.00	23,531,200
日立金属	213,800	2,179.00	465,870,200
日本金属	5,000	955.00	4,775,000
大太平洋金属	12,200	2,024.00	24,692,800
新日本電工	110,000	336.00	36,960,000

栗本鐵工所	8,200	1,626.00	13,333,200
虹技	2,600	862.00	2,241,200
三菱製鋼	12,800	929.00	11,891,200
日亜鋼業	22,900	226.00	5,175,400
日本精線	3,100	4,545.00	14,089,500
エンビプロ・ホールディングス	13,200	743.00	9,807,600
シンニッタン	24,300	212.00	5,151,600
新家工業	4,200	1,861.00	7,816,200
大紀アルミニウム工業所	24,500	1,272.00	31,164,000
日本軽金属ホールディングス	50,300	1,458.00	73,337,400
三井金属鉱業	53,600	3,005.00	161,068,000
東邦亜鉛	10,200	2,132.00	21,746,400
三菱マテリアル	114,700	1,972.00	226,188,400
住友金属鉱山	217,400	4,149.00	901,992,600
D O W Aホールディングス	46,400	4,930.00	228,752,000
古河機械金属	30,300	1,265.00	38,329,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,000	3,255.00	74,865,000
東邦チタニウム	35,600	2,148.00	76,468,800
U A C J	27,100	2,042.00	55,338,200
C Kサンエツ	3,700	4,375.00	16,187,500
古河電気工業	57,300	2,301.00	131,847,300
住友電気工業	692,500	1,529.00	1,058,832,500
フジクラ	221,300	876.00	193,858,800
昭和電線ホールディングス	17,300	1,805.00	31,226,500
東京特殊電線	2,600	2,209.00	5,743,400
タツタ電線	35,200	447.00	15,734,400
カナレ電気	3,000	1,383.00	4,149,000
平河ヒューテック	11,100	1,059.00	11,754,900
リョービ	18,400	1,287.00	23,680,800
アーレスティ	21,400	366.00	7,832,400
アサヒホールディングス	79,500	1,932.00	153,594,000
稲葉製作所	10,000	1,378.00	13,780,000
宮地エンジニアリンググループ	5,600	3,255.00	18,228,000
トーカロ	51,200	1,143.00	58,521,600
アルファC o	7,000	937.00	6,559,000
S U M C O	327,200	1,834.00	600,084,800
川田テクノロジーズ	3,700	3,810.00	14,097,000
R S Technologies	5,600	6,340.00	35,504,000
ジェイテックコーポレーション	2,600	1,457.00	3,788,200
信和	12,300	787.00	9,680,100
東洋製罐グループホールディングス	101,100	1,776.00	179,553,600
ホッカンホールディングス	9,200	1,329.00	12,226,800

コロナ	9,600	842.00	8,083,200
横河ブリッジホールディングス	28,400	1,958.00	55,607,200
駒井ハルテック	3,100	1,614.00	5,003,400
高田機工	1,700	2,367.00	4,023,900
三和ホールディングス	187,100	1,250.00	233,875,000
文化シャッター	58,500	1,070.00	62,595,000
三協立山	23,600	548.00	12,932,800
アルインコ	13,100	1,029.00	13,479,900
東洋シャッター	4,400	504.00	2,217,600
LIXIL	286,200	2,166.00	619,909,200
日本フィルコン	12,400	445.00	5,518,000
ノーリツ	25,300	1,528.00	38,658,400
長府製作所	17,300	2,047.00	35,413,100
リンナイ	34,300	10,040.00	344,372,000
ダイニチ工業	9,500	652.00	6,194,000
日東精工	24,900	535.00	13,321,500
三洋工業	2,400	1,616.00	3,878,400
岡部	27,600	656.00	18,105,600
ジーテクト	21,900	1,298.00	28,426,200
東プレ	30,300	1,178.00	35,693,400
高周波熱錬	30,600	677.00	20,716,200
東京製綱	12,200	901.00	10,992,200
サンコール	17,000	685.00	11,645,000
モリテック スチール	15,500	350.00	5,425,000
パイオラックス	26,100	1,858.00	48,493,800
エイチワン	17,700	596.00	10,549,200
日本発條	167,300	825.00	138,022,500
中央発條	9,500	675.00	6,412,500
アドバネクス	2,600	1,153.00	2,997,800
立川ブラインド工業	7,800	1,051.00	8,197,800
三益半導体工業	15,500	2,130.00	33,015,000
日本ドライケミカル	4,500	1,406.00	6,327,000
日本製鋼所	51,000	3,100.00	158,100,000
三浦工業	78,100	3,010.00	235,081,000
タクマ	57,100	1,238.00	70,689,800
ツガミ	40,700	1,164.00	47,374,800
オークマ	19,000	5,080.00	96,520,000
芝浦機械	22,500	2,905.00	65,362,500
アマダ	313,400	1,036.00	324,682,400
アイダエンジニアリング	43,500	849.00	36,931,500
TAKISAWA	5,800	1,058.00	6,136,400
FUJI	79,300	1,943.00	154,079,900

牧野フライス製作所	20,200	4,560.00	92,112,000
オーエスジー	80,400	1,832.00	147,292,800
ダイジェット工業	2,300	824.00	1,895,200
旭ダイヤモンド工業	48,900	725.00	35,452,500
D M G 森精機	102,100	1,690.00	172,549,000
ソディック	46,900	773.00	36,253,700
ディスコ	29,200	31,000.00	905,200,000
日東工器	9,600	1,557.00	14,947,200
日進工具	15,700	1,169.00	18,353,300
パンチ工業	17,300	412.00	7,127,600
富士ダイス	10,100	568.00	5,736,800
豊和工業	10,400	866.00	9,006,400
ニデックオーケーケー	7,500	1,080.00	8,100,000
東洋機械金属	13,100	566.00	7,414,600
津田駒工業	3,400	502.00	1,706,800
エンシュウ	4,700	751.00	3,529,700
島精機製作所	29,100	2,124.00	61,808,400
オプトラン	24,900	2,095.00	52,165,500
N C ホールディングス	5,600	1,840.00	10,304,000
イワキポンプ	12,700	1,483.00	18,834,100
フリー	17,700	1,155.00	20,443,500
ヤマシンフィルタ	31,400	426.00	13,376,400
日阪製作所	20,500	836.00	17,138,000
やまびこ	27,600	1,105.00	30,498,000
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,205.00	20,512,000
平田機工	8,700	4,125.00	35,887,500
ペガサスミシン製造	20,200	867.00	17,513,400
マルマエ	8,200	1,624.00	13,316,800
タツモ	9,300	1,299.00	12,080,700
ナプテスコ	105,700	3,035.00	320,799,500
三井海洋開発	21,200	1,500.00	31,800,000
レオン自動機	21,300	1,136.00	24,196,800
S M C	58,800	58,220.00	3,423,336,000
ホソカワミクロン	12,900	2,612.00	33,694,800
ユニオンツール	7,400	3,475.00	25,715,000
オイレス工業	25,700	1,488.00	38,241,600
日精エー・エス・ビー機械	7,700	3,960.00	30,492,000
サトーホールディングス	26,200	1,850.00	48,470,000
技研製作所	17,600	3,045.00	53,592,000
日本エアータック	8,600	1,099.00	9,451,400
カワタ	6,000	836.00	5,016,000
日精樹脂工業	12,700	951.00	12,077,700

オカダアイヨン	6,300	1,393.00	8,775,900
ワイエイシイホールディングス	8,000	1,241.00	9,928,000
小松製作所	909,500	2,663.50	2,422,453,250
住友重機械工業	107,300	2,779.00	298,186,700
日立建機	80,500	2,651.00	213,405,500
日工	25,300	615.00	15,559,500
巴工業	7,300	2,456.00	17,928,800
井関農機	15,900	1,214.00	19,302,600
TOWA	17,200	1,657.00	28,500,400
丸山製作所	3,300	1,428.00	4,712,400
北川鉄工所	8,000	1,269.00	10,152,000
ローツェ	9,900	6,940.00	68,706,000
タカキタ	6,300	462.00	2,910,600
クボタ	897,400	2,000.00	1,794,800,000
荏原実業	8,500	2,176.00	18,496,000
三菱化工機	6,000	2,114.00	12,684,000
月島機械	31,500	925.00	29,137,500
帝国電機製作所	12,800	1,970.00	25,216,000
新東工業	37,700	689.00	25,975,300
澁谷工業	15,900	2,516.00	40,004,400
アイチ コーポレーション	28,900	792.00	22,888,800
小森コーポレーション	46,400	731.00	33,918,400
鶴見製作所	14,200	2,320.00	32,944,000
住友精密工業	3,000	2,441.00	7,323,000
日本ギア工業	7,400	367.00	2,715,800
酒井重工業	3,300	2,925.00	9,652,500
荏原製作所	68,900	4,760.00	327,964,000
石井鐵工所	2,400	2,573.00	6,175,200
西島製作所	16,500	1,316.00	21,714,000
北越工業	17,000	1,050.00	17,850,000
ダイキン工業	219,100	22,245.00	4,873,879,500
オルガノ	23,200	2,117.00	49,114,400
トーヨーカネツ	7,100	2,484.00	17,636,400
栗田工業	101,400	5,180.00	525,252,000
椿本チエイン	26,300	3,110.00	81,793,000
大同工業	8,500	716.00	6,086,000
木村化工機	15,700	705.00	11,068,500
アネスト岩田	31,300	912.00	28,545,600
ダイフク	94,700	6,810.00	644,907,000
サムコ	5,500	2,941.00	16,175,500
加藤製作所	9,800	717.00	7,026,600
油研工業	3,200	1,764.00	5,644,800

タダノ	97,100	907.00	88,069,700
フジテック	61,600	2,990.00	184,184,000
C K D	50,800	1,745.00	88,646,000
キトー	15,800	2,721.00	42,991,800
平和	56,000	2,404.00	134,624,000
理想科学工業	16,900	2,378.00	40,188,200
S A N K Y O	41,300	4,920.00	203,196,000
日本金銭機械	20,500	712.00	14,596,000
マースグループホールディングス	12,800	1,761.00	22,540,800
フクシマガリレイ	12,400	4,065.00	50,406,000
オーイズミ	7,300	448.00	3,270,400
ダイコク電機	9,300	1,423.00	13,233,900
竹内製作所	30,600	2,856.00	87,393,600
アマノ	52,600	2,536.00	133,393,600
J U K I	26,200	715.00	18,733,000
ジャノメ	17,200	624.00	10,732,800
マックス	23,700	2,069.00	49,035,300
グローリー	47,600	2,266.00	107,861,600
新晃工業	18,700	1,580.00	29,546,000
大和冷機工業	25,900	1,193.00	30,898,700
セガサミーホールディングス	180,400	1,891.00	341,136,400
日本ピストンリング	7,400	1,189.00	8,798,600
リケン	7,300	2,305.00	16,826,500
T P R	21,900	1,231.00	26,958,900
ツバキ・ナカシマ	41,500	1,211.00	50,256,500
ホシザキ	108,300	4,210.00	455,943,000
大豊工業	16,500	706.00	11,649,000
日本精工	343,600	741.00	254,607,600
N T N	364,900	261.00	95,238,900
ジェイテクト	171,200	970.00	166,064,000
不二越	12,400	3,805.00	47,182,000
日本トムソン	46,000	517.00	23,782,000
T H K	97,100	2,524.00	245,080,400
ユーシン精機	15,700	693.00	10,880,100
前澤給装工業	13,000	922.00	11,986,000
イーグル工業	21,800	1,079.00	23,522,200
前澤工業	12,200	614.00	7,490,800
日本ピラー工業	17,200	2,377.00	40,884,400
キッツ	62,100	850.00	52,785,000
マキタ	226,800	2,799.00	634,813,200
三井E & Sホールディングス	76,100	406.00	30,896,600
日立造船	159,300	829.00	132,059,700

三菱重工業	294,300	4,892.00	1,439,715,600
I H I	125,300	3,190.00	399,707,000
スター精密	31,800	1,686.00	53,614,800
日清紡ホールディングス	137,000	1,036.00	141,932,000
イビデン	96,600	4,070.00	393,162,000
コニカミノルタ	408,100	446.00	182,012,600
ブラザー工業	228,900	2,588.00	592,393,200
ミネベアミツミ	319,500	2,087.00	666,796,500
日立製作所	965,100	6,412.00	6,188,221,200
東芝	350,800	5,403.00	1,895,372,400
三菱電機	1,872,700	1,389.00	2,601,180,300
富士電機	111,600	5,240.00	584,784,000
東洋電機製造	6,700	863.00	5,782,100
安川電機	199,400	4,065.00	810,561,000
シンフォニアテクノロジー	20,400	1,365.00	27,846,000
明電舎	28,400	1,930.00	54,812,000
オリジン	4,600	1,235.00	5,681,000
山洋電気	7,400	4,850.00	35,890,000
デンヨー	14,200	1,424.00	20,220,800
P H C ホールディングス	31,400	1,448.00	45,467,200
東芝テック	21,500	3,950.00	84,925,000
芝浦メカトロニクス	3,600	9,100.00	32,760,000
マブチモーター	41,900	3,915.00	164,038,500
日本電産	445,800	7,737.00	3,449,154,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,000	527.00	4,216,000
トレックス・セミコンダクター	8,800	2,580.00	22,704,000
東光高岳	11,400	1,813.00	20,668,200
ダブル・スコープ	55,000	1,611.00	88,605,000
ダイヘン	18,600	3,645.00	67,797,000
ヤーマン	33,100	1,113.00	36,840,300
J V C ケンウッド	165,600	214.00	35,438,400
ミマキエンジニアリング	18,600	676.00	12,573,600
I - P E X	9,700	1,271.00	12,328,700
日新電機	47,000	1,340.00	62,980,000
大崎電気工業	33,800	525.00	17,745,000
オムロン	167,000	6,834.00	1,141,278,000
日東工業	25,200	2,518.00	63,453,600
I D E C	24,800	3,080.00	76,384,000
正興電機製作所	7,500	992.00	7,440,000
不二電機工業	4,200	1,074.00	4,510,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	60,500	2,207.00	133,523,500
サクサホールディングス	4,700	1,211.00	5,691,700

メルコホールディングス	5,700	2,983.00	17,003,100
テクノメディカ	4,800	1,640.00	7,872,000
日本電気	238,000	4,840.00	1,151,920,000
富士通	180,500	16,195.00	2,923,197,500
沖電気工業	76,100	732.00	55,705,200
岩崎通信機	8,200	737.00	6,043,400
電気興業	9,700	2,275.00	22,067,500
サンケン電気	17,200	4,485.00	77,142,000
ナカヨ	3,300	1,080.00	3,564,000
アイホン	9,100	1,998.00	18,181,800
ルネサスエレクトロニクス	1,097,200	1,203.00	1,319,931,600
セイコーエプソン	224,100	2,031.00	455,147,100
ワコム	154,400	628.00	96,963,200
アルバック	40,000	5,480.00	219,200,000
アクセル	8,100	1,104.00	8,942,400
E I Z O	13,700	3,730.00	51,101,000
日本信号	42,600	1,010.00	43,026,000
京三製作所	39,200	399.00	15,640,800
能美防災	23,000	1,616.00	37,168,000
ホーチキ	12,900	1,454.00	18,756,600
星和電機	8,500	424.00	3,604,000
エレコム	46,300	1,340.00	62,042,000
パナソニック ホールディングス	2,140,000	1,043.50	2,233,090,000
シャープ	190,600	864.00	164,678,400
アンリツ	127,000	1,615.00	205,105,000
富士通ゼネラル	54,500	3,050.00	166,225,000
ソニーグループ	1,257,000	9,725.00	12,224,325,000
T D K	290,700	4,575.00	1,329,952,500
帝国通信工業	9,200	1,450.00	13,340,000
タムラ製作所	72,200	714.00	51,550,800
アルプスアルパイン	164,300	1,094.00	179,744,200
池上通信機	5,900	540.00	3,186,000
日本電波工業	20,400	1,469.00	29,967,600
鈴木	10,400	863.00	8,975,200
メイコー	21,900	2,509.00	54,947,100
日本トリム	4,000	2,328.00	9,312,000
ローランド ディー . ジー .	9,600	3,055.00	29,328,000
フォスター電機	18,700	756.00	14,137,200
S M K	4,500	2,533.00	11,398,500
ヨコオ	13,600	1,954.00	26,574,400
ホシデン	44,600	1,510.00	67,346,000
ヒロセ電機	27,800	19,840.00	551,552,000

日本航空電子工業	40,300	2,034.00	81,970,200
TOA	21,500	788.00	16,942,000
マクセル	36,900	1,347.00	49,704,300
古野電気	24,300	1,053.00	25,587,900
ユニデンホールディングス	1,800	4,090.00	7,362,000
スミダコーポレーション	15,900	932.00	14,818,800
アイコム	6,500	2,550.00	16,575,000
リオン	7,100	2,075.00	14,732,500
横河電機	184,100	2,368.00	435,948,800
新電元工業	7,100	3,595.00	25,524,500
アズビル	116,400	3,970.00	462,108,000
東亜ディーケーケー	10,400	838.00	8,715,200
日本光電工業	77,100	3,405.00	262,525,500
チノー	6,300	1,679.00	10,577,700
共和電業	17,500	335.00	5,862,500
日本電子材料	9,400	1,387.00	13,037,800
堀場製作所	37,100	5,780.00	214,438,000
アドバンテスト	149,200	7,000.00	1,044,400,000
小野測器	8,000	385.00	3,080,000
エスベック	15,100	1,760.00	26,576,000
キーエンス	181,800	48,050.00	8,735,490,000
日置電機	8,800	6,600.00	58,080,000
シスメックス	143,700	7,881.00	1,132,499,700
日本マイクロニクス	27,800	1,282.00	35,639,600
メガチップス	18,000	2,450.00	44,100,000
OBARA GROUP	7,900	3,375.00	26,662,500
澤藤電機	2,800	1,125.00	3,150,000
原田工業	10,100	777.00	7,847,700
コーセル	22,800	818.00	18,650,400
イリソ電子工業	17,000	3,955.00	67,235,000
オブテックスグループ	30,800	1,987.00	61,199,600
千代田インテグレ	6,900	2,334.00	16,104,600
レーザーテック	82,300	18,580.00	1,529,134,000
スタンレー電気	129,500	2,434.00	315,203,000
岩崎電気	6,500	2,524.00	16,406,000
ウシオ電機	95,200	1,516.00	144,323,200
岡谷電機産業	16,100	248.00	3,992,800
ヘリオス テクノ ホールディング	18,000	502.00	9,036,000
エノモト	5,800	1,620.00	9,396,000
日本セラミック	17,100	2,563.00	43,827,300
遠藤照明	9,800	715.00	7,007,000
古河電池	14,700	1,084.00	15,934,800

双信電機	10,700	394.00	4,215,800
山一電機	13,300	1,973.00	26,240,900
図研	13,200	3,320.00	43,824,000
日本電子	38,600	5,260.00	203,036,000
カシオ計算機	124,100	1,315.00	163,191,500
ファナック	176,100	20,335.00	3,580,993,500
日本シイエムケイ	36,300	483.00	17,532,900
エンプラス	5,100	4,120.00	21,012,000
大真空	25,300	878.00	22,213,400
ローム	83,500	9,960.00	831,660,000
浜松ホトニクス	133,700	6,490.00	867,713,000
三井ハイテック	17,300	7,390.00	127,847,000
新光電気工業	59,100	3,240.00	191,484,000
京セラ	282,400	7,325.00	2,068,580,000
太陽誘電	89,400	3,790.00	338,826,000
村田製作所	547,400	6,971.00	3,815,925,400
双葉電子工業	35,100	606.00	21,270,600
北陸電気工業	7,900	1,036.00	8,184,400
ニチコン	53,800	1,311.00	70,531,800
日本ケミコン	19,200	1,792.00	34,406,400
K O A	27,900	2,223.00	62,021,700
市光工業	25,100	393.00	9,864,300
小糸製作所	200,500	2,073.00	415,636,500
ミツバ	31,200	392.00	12,230,400
S C R E E Nホールディングス	31,600	7,750.00	244,900,000
キャノン電子	18,700	1,634.00	30,555,800
キャノン	914,000	3,295.00	3,011,630,000
リコー	477,400	1,104.00	527,049,600
象印マホービン	50,000	1,496.00	74,800,000
M U T O Hホールディングス	2,800	1,904.00	5,331,200
東京エレクトロン	127,300	36,700.00	4,671,910,000
イノテック	12,300	1,236.00	15,202,800
トヨタ紡織	70,100	1,864.00	130,666,400
芦森工業	3,800	1,032.00	3,921,600
ユニプレス	32,900	873.00	28,721,700
豊田自動織機	142,100	7,320.00	1,040,172,000
モリタホールディングス	32,200	1,280.00	41,216,000
三櫻工業	27,700	668.00	18,503,600
デンソー	392,700	7,119.00	2,795,631,300
東海理化電機製作所	52,800	1,465.00	77,352,000
川崎重工業	136,000	2,409.00	327,624,000
名村造船所	51,800	544.00	28,179,200

日本車輛製造	6,400	2,049.00	13,113,600
三菱ロジスネクスト	26,600	733.00	19,497,800
近畿車輛	3,000	960.00	2,880,000
日産自動車	2,366,500	461.20	1,091,429,800
いすゞ自動車	581,200	1,668.00	969,441,600
トヨタ自動車	9,147,400	2,004.00	18,331,389,600
日野自動車	250,600	595.00	149,107,000
三菱自動車工業	742,700	504.00	374,320,800
エフテック	12,800	532.00	6,809,600
レシップホールディングス	7,900	466.00	3,681,400
G M B	3,600	735.00	2,646,000
ファルテック	3,500	608.00	2,128,000
武蔵精密工業	44,700	1,635.00	73,084,500
日産車体	29,400	804.00	23,637,600
新明和工業	52,300	1,026.00	53,659,800
極東開発工業	31,900	1,382.00	44,085,800
トピー工業	15,000	1,625.00	24,375,000
ティラド	5,400	2,642.00	14,266,800
曙ブレーキ工業	110,100	177.00	19,487,700
タチエス	32,900	1,098.00	36,124,200
N O K	75,500	1,128.00	85,164,000
フタバ産業	44,600	327.00	14,584,200
K Y B	17,600	3,145.00	55,352,000
大同メタル工業	38,500	495.00	19,057,500
プレス工業	89,900	411.00	36,948,900
ミクニ	23,300	315.00	7,339,500
太平洋工業	38,200	1,041.00	39,766,200
河西工業	24,600	194.00	4,772,400
アイシン	146,900	3,855.00	566,299,500
マツダ	590,400	964.00	569,145,600
今仙電機製作所	13,200	552.00	7,286,400
本田技研工業	1,467,000	3,263.00	4,786,821,000
スズキ	397,800	4,677.00	1,860,510,600
S U B A R U	527,100	2,310.00	1,217,601,000
安永	8,100	627.00	5,078,700
ヤマハ発動機	261,800	2,981.00	780,425,800
T B K	20,200	281.00	5,676,200
エクセディ	30,300	1,715.00	51,964,500
豊田合成	56,700	2,278.00	129,162,600
愛三工業	31,400	688.00	21,603,200
盟和産業	2,800	966.00	2,704,800
日本プラスト	14,500	430.00	6,235,000

ヨロズ	15,600	862.00	13,447,200
エフ・シー・シー	32,800	1,412.00	46,313,600
シマノ	68,100	21,555.00	1,467,895,500
テイ・エス テック	84,700	1,526.00	129,252,200
ジャムコ	11,700	1,713.00	20,042,100
テルモ	567,800	4,389.00	2,492,074,200
クリエートメディック	6,100	880.00	5,368,000
日機装	41,700	981.00	40,907,700
日本エム・ディ・エム	11,600	1,254.00	14,546,400
島津製作所	239,800	3,780.00	906,444,000
JMS	15,500	527.00	8,168,500
長野計器	13,300	1,079.00	14,350,700
ブイ・テクノロジー	8,800	2,705.00	23,804,000
東京計器	12,800	1,274.00	16,307,200
愛知時計電機	7,200	1,319.00	9,496,800
インターアクション	10,100	1,421.00	14,352,100
オーバル	18,000	434.00	7,812,000
東京精密	31,300	4,240.00	132,712,000
マニー	73,300	2,163.00	158,547,900
ニコン	282,900	1,355.00	383,329,500
トプコン	94,400	1,561.00	147,358,400
オリンパス	961,300	3,024.00	2,906,971,200
理研計器	13,300	3,940.00	52,402,000
タムロン	12,500	3,255.00	40,687,500
H O Y A	382,400	14,395.00	5,504,648,000
シード	9,400	506.00	4,756,400
ノーリツ鋼機	15,800	2,580.00	40,764,000
A & D ホロンホールディングス	22,600	891.00	20,136,600
朝日インテック	220,000	2,503.00	550,660,000
シチズン時計	183,200	636.00	116,515,200
リズム	6,300	1,605.00	10,111,500
大研医器	15,900	457.00	7,266,300
メニコン	61,900	2,933.00	181,552,700
シンシア	1,800	510.00	918,000
松風	6,700	2,587.00	17,332,900
セイコーグループ	28,400	3,390.00	96,276,000
ニプロ	138,900	1,109.00	154,040,100
K Y O R I T S U	27,500	117.00	3,217,500
中本パックス	5,600	1,500.00	8,400,000
スノーピーク	28,500	1,850.00	52,725,000
パラマウントベッドホールディングス	38,500	2,667.00	102,679,500
トランザクション	12,800	1,039.00	13,299,200

粧美堂	5,000	371.00	1,855,000
ニホンフラッシュ	15,600	978.00	15,256,800
前田工織	18,100	3,025.00	54,752,500
永大産業	21,900	219.00	4,796,100
アートネイチャー	17,100	761.00	13,013,100
バンダイナムコホールディングス	166,000	9,746.00	1,617,836,000
アイフィスジャパン	5,100	610.00	3,111,000
SHOEI	17,600	5,350.00	94,160,000
フランスベッドホールディングス	25,800	945.00	24,381,000
パイロットコーポレーション	26,000	5,820.00	151,320,000
萩原工業	11,100	1,061.00	11,777,100
フジシールインターナショナル	41,200	1,660.00	68,392,000
タカラトミー	82,800	1,262.00	104,493,600
広済堂ホールディングス	12,400	1,525.00	18,910,000
エステールホールディングス	4,300	619.00	2,661,700
タカノ	6,900	679.00	4,685,100
プロネクサス	15,500	971.00	15,050,500
ホクシン	14,100	148.00	2,086,800
ウッドワン	6,100	951.00	5,801,100
大建工業	10,100	1,878.00	18,967,800
凸版印刷	261,400	2,180.00	569,852,000
大日本印刷	217,400	2,903.00	631,112,200
共同印刷	5,200	2,608.00	13,561,600
NISSHA	31,700	1,688.00	53,509,600
光村印刷	1,500	1,188.00	1,782,000
TAKARA & COMPANY	11,500	2,186.00	25,139,000
アシックス	153,800	2,323.00	357,277,400
ツツミ	5,000	1,957.00	9,785,000
ローランド	12,200	4,205.00	51,301,000
小松ウオール工業	6,100	1,903.00	11,608,300
ヤマハ	116,700	5,570.00	650,019,000
河合楽器製作所	5,100	2,694.00	13,739,400
クリナップ	18,700	602.00	11,257,400
ピジョン	106,100	2,046.00	217,080,600
兼松サステック	1,300	1,577.00	2,050,100
キングジム	14,700	924.00	13,582,800
リンテック	38,200	2,228.00	85,109,600
イトーキ	34,100	425.00	14,492,500
任天堂	1,132,700	6,096.00	6,904,939,200
三菱鉛筆	24,000	1,425.00	34,200,000
タカラスタンダード	32,200	1,302.00	41,924,400
コクヨ	80,200	1,850.00	148,370,000

ナカバヤシ	16,100	531.00	8,549,100
グロープライド	15,000	2,187.00	32,805,000
オカムラ	56,400	1,373.00	77,437,200
美津濃	16,600	2,560.00	42,496,000
東京電力ホールディングス	1,501,700	482.00	723,819,400
中部電力	566,700	1,233.00	698,741,100
関西電力	701,800	1,139.00	799,350,200
中国電力	289,400	685.00	198,239,000
北陸電力	170,300	464.00	79,019,200
東北電力	438,600	609.00	267,107,400
四国電力	166,800	680.00	113,424,000
九州電力	384,000	728.00	279,552,000
北海道電力	174,400	435.00	75,864,000
沖縄電力	42,600	979.00	41,705,400
電源開発	148,200	2,104.00	311,812,800
エフオン	12,100	646.00	7,816,600
イーレックス	25,800	2,578.00	66,512,400
レノバ	39,400	3,505.00	138,097,000
東京瓦斯	352,200	2,587.00	911,141,400
大阪瓦斯	337,500	2,203.00	743,512,500
東邦瓦斯	78,700	2,883.00	226,892,100
北海道瓦斯	9,900	1,659.00	16,424,100
広島ガス	35,100	342.00	12,004,200
西部ガスホールディングス	19,100	1,689.00	32,259,900
静岡ガス	38,000	1,045.00	39,710,000
メタウォーター	20,800	1,889.00	39,291,200
SBSホールディングス	14,800	2,893.00	42,816,400
東武鉄道	183,000	3,555.00	650,565,000
相鉄ホールディングス	59,600	2,401.00	143,099,600
東急	467,100	1,759.00	821,628,900
京浜急行電鉄	223,300	1,575.00	351,697,500
小田急電鉄	252,500	1,902.00	480,255,000
京王電鉄	88,100	5,410.00	476,621,000
京成電鉄	121,900	3,965.00	483,333,500
富士急行	20,500	4,710.00	96,555,000
東日本旅客鉄道	306,100	8,187.00	2,506,040,700
西日本旅客鉄道	212,800	6,027.00	1,282,545,600
東海旅客鉄道	141,200	17,705.00	2,499,946,000
西武ホールディングス	241,800	1,465.00	354,237,000
鴻池運輸	28,400	1,576.00	44,758,400
西日本鉄道	48,200	2,965.00	142,913,000
ハマキョウレックス	13,000	3,230.00	41,990,000

サカイ引越センター	9,200	4,655.00	42,826,000
近鉄グループホールディングス	178,200	5,210.00	928,422,000
阪急阪神ホールディングス	221,800	4,525.00	1,003,645,000
南海電気鉄道	79,500	3,035.00	241,282,500
京阪ホールディングス	74,000	4,015.00	297,110,000
神戸電鉄	4,500	3,335.00	15,007,500
名古屋鉄道	183,800	2,335.00	429,173,000
山陽電気鉄道	13,600	2,302.00	31,307,200
アルプス物流	13,300	1,071.00	14,244,300
ヤマトホールディングス	260,300	2,192.00	570,577,600
山九	46,200	4,285.00	197,967,000
丸運	9,000	212.00	1,908,000
丸全昭和運輸	12,800	3,060.00	39,168,000
センコーグループホールディングス	88,100	993.00	87,483,300
トナミホールディングス	3,600	3,615.00	13,014,000
ニッコンホールディングス	57,300	2,352.00	134,769,600
日本石油輸送	2,100	2,214.00	4,649,400
福山通運	24,300	3,300.00	80,190,000
セイノーホールディングス	103,500	1,159.00	119,956,500
エスライン	5,200	802.00	4,170,400
神奈川中央交通	4,700	3,460.00	16,262,000
日立物流	36,700	8,630.00	316,721,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	32,100	1,480.00	47,508,000
C & F ロジホールディングス	16,000	1,222.00	19,552,000
九州旅客鉄道	127,400	3,195.00	407,043,000
S Gホールディングス	319,200	2,005.00	639,996,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	62,100	7,440.00	462,024,000
日本郵船	477,300	2,685.00	1,281,550,500
商船三井	293,600	2,889.00	848,210,400
川崎汽船	176,300	2,282.00	402,316,600
N S ユナイテッド海運	9,400	3,895.00	36,613,000
飯野海運	77,000	744.00	57,288,000
共栄タンカー	5,200	883.00	4,591,600
乾汽船	12,300	1,838.00	22,607,400
日本航空	408,500	2,837.00	1,158,914,500
A N Aホールディングス	452,600	2,966.50	1,342,637,900
パスコ	3,600	1,294.00	4,658,400
ランコム	5,300	8,180.00	43,354,000
日新	13,900	1,953.00	27,146,700
三菱倉庫	46,000	3,440.00	158,240,000
三井倉庫ホールディングス	18,600	3,260.00	60,636,000
住友倉庫	55,800	2,047.00	114,222,600

澁澤倉庫	9,500	2,031.00	19,294,500
東陽倉庫	26,900	236.00	6,348,400
日本トランスシティ	33,500	487.00	16,314,500
ケイヒン	3,300	1,407.00	4,643,100
中央倉庫	9,800	923.00	9,045,400
川西倉庫	3,500	1,007.00	3,524,500
安田倉庫	12,800	929.00	11,891,200
ファイブホールディングス	4,000	856.00	3,424,000
東洋埠頭	5,300	1,136.00	6,020,800
上組	90,300	2,912.00	262,953,600
サンリツ	4,900	660.00	3,234,000
キムラユニティー	9,900	752.00	7,444,800
キューソー流通システム	11,100	1,081.00	11,999,100
東海運	10,800	272.00	2,937,600
エーアイティー	11,900	1,551.00	18,456,900
内外トランスライン	6,000	2,030.00	12,180,000
日本コンセプト	5,200	1,706.00	8,871,200
NEC ネットエスアイ	65,300	1,625.00	106,112,500
クロスキャット	10,800	1,371.00	14,806,800
システナ	281,400	417.00	117,343,800
デジタルアーツ	10,600	6,580.00	69,748,000
日鉄ソリューションズ	34,300	3,590.00	123,137,000
キューブシステム	10,200	979.00	9,985,800
コア	8,500	1,415.00	12,027,500
手間いらず	2,900	5,800.00	16,820,000
ラクーンホールディングス	16,900	1,167.00	19,722,300
ソリトンシステムズ	8,800	1,028.00	9,046,400
ソフトクリエイトホールディングス	8,700	3,210.00	27,927,000
T I S	172,200	3,945.00	679,329,000
J N S ホールディングス	9,600	373.00	3,580,800
グリー	89,800	834.00	74,893,200
G M O ペパボ	2,500	1,941.00	4,852,500
コーエーテクモホールディングス	125,700	2,193.00	275,660,100
三菱総合研究所	8,200	4,875.00	39,975,000
電算	2,300	1,617.00	3,719,100
A G S	8,100	610.00	4,941,000
ファインデックス	13,600	586.00	7,969,600
ブレインパッド	16,900	910.00	15,379,000
K L a b	32,700	467.00	15,270,900
ポルトゥウィンホールディングス	28,800	923.00	26,582,400
ネクソン	431,600	2,533.00	1,093,242,800
アイスタイル	51,300	491.00	25,188,300

エムアップホールディングス	22,900	1,536.00	35,174,400
エイチーム	12,600	772.00	9,727,200
エニグモ	21,700	547.00	11,869,900
テクノスジャパン	15,700	449.00	7,049,300
コロプラ	65,100	676.00	44,007,600
ブロードリーフ	98,000	516.00	50,568,000
クロス・マーケティンググループ	7,700	883.00	6,799,100
デジタルハーツホールディングス	9,000	1,921.00	17,289,000
システム情報	15,000	984.00	14,760,000
メディアドゥ	6,900	1,945.00	13,420,500
じげん	56,300	362.00	20,380,600
ブイキューブ	20,300	951.00	19,305,300
エンカレッジ・テクノロジー	4,700	514.00	2,415,800
サイバーリンクス	6,100	1,341.00	8,180,100
フィックスターズ	19,100	1,054.00	20,131,400
CARTA HOLDINGS	8,200	1,741.00	14,276,200
オブティム	14,000	870.00	12,180,000
セレス	6,900	890.00	6,141,000
SHIFT	12,200	19,400.00	236,680,000
ティーガイア	17,600	1,665.00	29,304,000
セック	3,000	2,232.00	6,696,000
テクマトリックス	33,400	1,714.00	57,247,600
プロシップ	6,700	1,551.00	10,391,700
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	51,200	2,130.00	109,056,000
GMOペイメントゲートウェイ	38,200	9,980.00	381,236,000
ザッパラス	7,400	365.00	2,701,000
システムリサーチ	5,800	1,932.00	11,205,600
インターネットイニシアティブ	105,000	2,280.00	239,400,000
さくらインターネット	21,500	551.00	11,846,500
ヴァンクス	5,700	1,509.00	8,601,300
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,100	4,580.00	23,358,000
SRAホールディングス	9,600	3,210.00	30,816,000
システムインテグレータ	6,700	458.00	3,068,600
朝日ネット	18,300	607.00	11,108,100
eBASE	23,900	553.00	13,216,700
アバントグループ	21,200	1,512.00	32,054,400
アドソル日進	7,200	1,535.00	11,052,000
ODKソリューションズ	4,500	602.00	2,709,000
フリービット	10,400	1,013.00	10,535,200
コムチュア	22,200	2,390.00	53,058,000
サイバーコム	3,200	1,430.00	4,576,000
アステリア	14,400	823.00	11,851,200

アイル	9,500	1,828.00	17,366,000
マークライنز	9,100	2,555.00	23,250,500
メディカル・データ・ビジョン	25,100	1,092.00	27,409,200
g u m i	27,500	995.00	27,362,500
ショーケース	4,800	394.00	1,891,200
モバイルファクトリー	4,100	955.00	3,915,500
テラスカイ	7,300	2,415.00	17,629,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,800	1,680.00	14,784,000
P C Iホールディングス	7,900	1,006.00	7,947,400
アイビーシー	3,300	448.00	1,478,400
ネオジャパン	5,800	998.00	5,788,400
P R T I M E S	4,300	2,279.00	9,799,700
ラクス	90,500	1,496.00	135,388,000
ランドコンピュータ	4,700	840.00	3,948,000
ダブルスタンダード	6,000	2,487.00	14,922,000
オープンドア	11,800	1,888.00	22,278,400
マイネット	6,400	466.00	2,982,400
アカツキ	8,900	2,051.00	18,253,900
ベネフィットジャパン	1,600	1,521.00	2,433,600
U b i c o mホールディングス	5,300	2,234.00	11,840,200
カナミックネットワーク	24,400	598.00	14,591,200
ノムラシステムコーポレーション	19,200	123.00	2,361,600
チェンジ	41,000	1,910.00	78,310,000
シンクロ・フード	10,500	530.00	5,565,000
オークネット	8,800	2,296.00	20,204,800
キャピタル・アセット・プランニング	4,000	586.00	2,344,000
セグエグループ	5,400	712.00	3,844,800
エイトレッド	2,900	1,681.00	4,874,900
マクロミル	38,000	1,073.00	40,774,000
ビーグリー	3,300	1,299.00	4,286,700
オロ	5,200	1,452.00	7,550,400
ユーザーローカル	6,100	1,599.00	9,753,900
テモナ	4,400	276.00	1,214,400
ニーズウェル	6,100	657.00	4,007,700
マネーフォワード	40,300	3,820.00	153,946,000
サインポスト	6,400	734.00	4,697,600
電算システムホールディングス	8,200	2,279.00	18,687,800
ソルクシーズ	15,700	366.00	5,746,200
フェイス	5,600	527.00	2,951,200
プロトコーポレーション	21,100	1,114.00	23,505,400
ハイマックス	5,400	1,514.00	8,175,600
野村総合研究所	342,500	3,530.00	1,209,025,000

サイバネットシステム	14,200	1,019.00	14,469,800
C Eホールディングス	10,000	465.00	4,650,000
日本システム技術	7,100	1,346.00	9,556,600
インテージホールディングス	22,800	1,652.00	37,665,600
東邦システムサイエンス	5,400	982.00	5,302,800
ソースネクスト	85,700	325.00	27,852,500
インフォコム	21,600	2,030.00	43,848,000
シンプレクス・ホールディングス	31,500	2,019.00	63,598,500
HEROZ	5,800	1,056.00	6,124,800
ラクスル	23,600	2,745.00	64,782,000
メルカリ	75,200	2,141.00	161,003,200
I P S	5,500	3,070.00	16,885,000
F I G	22,000	402.00	8,844,000
システムサポート	7,300	1,345.00	9,818,500
イーソル	11,100	566.00	6,282,600
アルテリア・ネットワークス	18,900	1,195.00	22,585,500
東海ソフト	3,300	920.00	3,036,000
ウイングアーク1st	15,100	2,165.00	32,691,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,600	1,636.00	7,525,600
サーバーワークス	3,500	2,458.00	8,603,000
東名	1,600	1,497.00	2,395,200
ヴィッツ	2,000	955.00	1,910,000
トピラシステムズ	4,900	900.00	4,410,000
S a n s a n	62,500	1,223.00	76,437,500
L i n k - U	3,800	753.00	2,861,400
ギフトィ	18,100	2,345.00	42,444,500
ベース	5,700	3,920.00	22,344,000
J M D C	26,600	4,845.00	128,877,000
フォーカスシステムズ	12,400	1,009.00	12,511,600
クレスコ	14,500	1,722.00	24,969,000
フジ・メディア・ホールディングス	175,300	1,060.00	185,818,000
オービック	62,100	20,890.00	1,297,269,000
ジャストシステム	28,100	3,020.00	84,862,000
T D C ソフト	15,800	1,312.00	20,729,600
Zホールディングス	2,840,400	384.00	1,090,713,600
トレンドマイクロ	96,500	7,570.00	730,505,000
I Dホールディングス	12,600	929.00	11,705,400
日本オラクル	32,000	8,110.00	259,520,000
アルファシステムズ	5,300	4,380.00	23,214,000
フューチャー	41,700	1,643.00	68,513,100
C A C H o l d i n g s	10,400	1,537.00	15,984,800
S Bテクノロジー	8,600	2,215.00	19,049,000

トーセ	5,100	781.00	3,983,100
オービックビジネスコンサルタント	18,800	4,465.00	83,942,000
伊藤忠テクノソリューションズ	89,800	3,580.00	321,484,000
アイティフォー	24,100	777.00	18,725,700
東計電算	2,400	6,080.00	14,592,000
エクスネット	3,300	996.00	3,286,800
大塚商会	94,700	4,685.00	443,669,500
サイボウズ	23,100	1,675.00	38,692,500
電通国際情報サービス	20,400	4,590.00	93,636,000
A C C E S S	22,500	776.00	17,460,000
デジタルガレージ	32,700	3,395.00	111,016,500
E M システムズ	28,100	869.00	24,418,900
ウェザーニューズ	5,900	7,240.00	42,716,000
C I J	15,500	820.00	12,710,000
ビジネスエンジニアリング	4,600	2,057.00	9,462,200
日本エンタープライズ	20,800	136.00	2,828,800
WOWOW	8,300	1,290.00	10,707,000
スカラ	16,800	719.00	12,079,200
インテリジェント ウェイブ	10,200	789.00	8,047,800
WOW WORLD GROUP	3,000	921.00	2,763,000
I M A G I C A G R O U P	14,200	921.00	13,078,200
ネットワンシステムズ	72,700	3,020.00	219,554,000
システムソフト	60,300	102.00	6,150,600
アルゴグラフィックス	15,400	3,920.00	60,368,000
マーベラス	31,300	688.00	21,534,400
エイベックス	34,100	1,693.00	57,731,300
B I P R O G Y	61,600	3,210.00	197,736,000
兼松エレクトロニクス	10,800	4,195.00	45,306,000
都築電気	9,000	1,286.00	11,574,000
T B S ホールディングス	96,300	1,578.00	151,961,400
日本テレビホールディングス	164,500	1,151.00	189,339,500
朝日放送グループホールディングス	16,000	621.00	9,936,000
テレビ朝日ホールディングス	47,500	1,414.00	67,165,000
スカパーJ S A T ホールディングス	167,200	518.00	86,609,600
テレビ東京ホールディングス	12,100	1,931.00	23,365,100
日本BS放送	6,900	904.00	6,237,600
ビジョン	22,100	1,324.00	29,260,400
スマートバリュー	5,000	476.00	2,380,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	15,100	2,254.00	34,035,400
ワイヤレスゲート	8,800	279.00	2,455,200
コネクシオ	14,100	1,136.00	16,017,600
クロップス	3,800	994.00	3,777,200

日本電信電話	2,207,000	4,093.00	9,033,251,000	
KDDI	1,435,500	4,293.00	6,162,601,500	
ソフトバンク	2,982,400	1,453.00	4,333,427,200	
光通信	22,500	18,020.00	405,450,000	
エムティーアイ	15,700	507.00	7,959,900	
GMOインターネットグループ	62,200	2,593.00	161,284,600	
ファイバーゲート	9,200	912.00	8,390,400	
アイドママーケティングコミュニケーション	5,000	281.00	1,405,000	
KADOKAWA	106,100	2,673.00	283,605,300	
学研ホールディングス	28,000	948.00	26,544,000	
ゼンリン	32,400	904.00	29,289,600	
昭文社ホールディングス	8,700	296.00	2,575,200	
インプレスホールディングス	17,400	207.00	3,601,800	
アイネット	9,300	1,355.00	12,601,500	
松竹	11,300	11,710.00	132,323,000	
東宝	116,200	5,170.00	600,754,000	
東映	5,500	17,760.00	97,680,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	524,300	2,079.00	1,090,019,700	
ピー・シー・エー	11,700	1,005.00	11,758,500	
ビジネスブレイン太田昭和	6,700	1,521.00	10,190,700	
DTS	36,800	3,460.00	127,328,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	91,600	6,650.00	609,140,000	
シーイーシー	21,200	1,538.00	32,605,600	
カブコン	182,700	3,745.00	684,211,500	
アイ・エス・ビー	8,700	1,280.00	11,136,000	
ジャステック	10,400	1,285.00	13,364,000	
SCSK	136,400	2,194.00	299,261,600	
NSW	7,500	2,137.00	16,027,500	
アイネス	17,100	1,475.00	25,222,500	
TKC	30,000	3,735.00	112,050,000	
富士ソフト	18,900	7,900.00	149,310,000	
NSD	61,800	2,472.00	152,769,600	
コナミグループ	71,600	6,330.00	453,228,000	
福井コンピュータホールディングス	9,100	3,515.00	31,986,500	
JBCホールディングス	13,400	1,953.00	26,170,200	
ミロク情報サービス	17,500	1,467.00	25,672,500	
ソフトバンクグループ	1,180,700	5,780.00	6,824,446,000	
高千穂交易	7,000	2,028.00	14,196,000	
オルバヘルスケアホールディングス	3,200	1,488.00	4,761,600	
伊藤忠食品	4,000	5,050.00	20,200,000	
エレマテック	15,800	1,316.00	20,792,800	
あらた	14,600	4,075.00	59,495,000	

トーメンデバイス	3,000	5,290.00	15,870,000	
東京エレクトロン デバイス	5,900	5,650.00	33,335,000	
円谷フィールズホールディングス	17,300	1,823.00	31,537,900	
双日	202,700	2,198.00	445,534,600	
アルフレッサ ホールディングス	205,000	1,670.00	342,350,000	
横浜冷凍	48,000	908.00	43,584,000	
ラサ商事	9,000	1,001.00	9,009,000	
アルコニックス	25,100	1,358.00	34,085,800	
神戸物産	136,400	3,195.00	435,798,000	
ハイパー	3,800	454.00	1,725,200	
あい ホールディングス	28,200	2,160.00	60,912,000	
ディーブイエックス	6,800	899.00	6,113,200	
ダイワボウホールディングス	84,000	1,842.00	154,728,000	
マクニカホールディングス	47,100	2,720.00	128,112,000	
ラクト・ジャパン	6,800	2,135.00	14,518,000	
グリムス	8,800	1,643.00	14,458,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,500	660.00	20,790,000	
八洲電機	14,300	1,012.00	14,471,600	
メディアスホールディングス	11,300	700.00	7,910,000	
レスターホールディングス	18,800	1,984.00	37,299,200	
ジューテックホールディングス	3,900	1,030.00	4,017,000	
大光	8,400	698.00	5,863,200	
OCHIホールディングス	4,500	1,206.00	5,427,000	
TOKAIホールディングス	95,800	894.00	85,645,200	
黒谷	5,400	548.00	2,959,200	
Cominix	3,500	717.00	2,509,500	
三洋貿易	18,100	1,049.00	18,986,900	
ビューティガレージ	3,200	2,613.00	8,361,600	
ウイン・パートナーズ	14,300	990.00	14,157,000	
ミタチ産業	5,000	898.00	4,490,000	
シップヘルスケアホールディングス	57,000	2,883.00	164,331,000	
明治電機工業	6,000	1,053.00	6,318,000	
デリカフーズホールディングス	7,700	509.00	3,919,300	
スターティアホールディングス	4,500	1,172.00	5,274,000	
コメダホールディングス	43,200	2,448.00	105,753,600	
ピーバンドットコム	2,800	512.00	1,433,600	
アセンテック	6,800	517.00	3,515,600	
富士興産	4,900	1,166.00	5,713,400	
協栄産業	2,000	1,464.00	2,928,000	
フルサト・マルカホールディングス	17,500	3,555.00	62,212,500	
ヤマエグループホールディングス	11,100	1,542.00	17,116,200	
小野建	17,700	1,445.00	25,576,500	

南陽	3,700	1,797.00	6,648,900
佐島電機	12,300	1,276.00	15,694,800
エコートレーディング	4,200	538.00	2,259,600
伯東	11,500	3,460.00	39,790,000
コンドーテック	14,800	1,009.00	14,933,200
中山福	10,500	317.00	3,328,500
ナガイレーベン	22,300	2,011.00	44,845,300
三菱食品	19,000	3,100.00	58,900,000
松田産業	13,400	2,201.00	29,493,400
第一興商	37,500	4,240.00	159,000,000
メディカルホールディングス	182,800	1,839.00	336,169,200
S P K	7,800	1,420.00	11,076,000
萩原電気ホールディングス	6,800	2,177.00	14,803,600
アズワン	28,400	6,080.00	172,672,000
スズデン	6,200	2,349.00	14,563,800
尾家産業	4,700	839.00	3,943,300
シモジマ	12,100	1,034.00	12,511,400
ドウシシャ	18,700	1,474.00	27,563,800
小津産業	4,400	1,541.00	6,780,400
高速	10,500	1,560.00	16,380,000
たけびし	6,700	1,467.00	9,828,900
リックス	4,100	2,135.00	8,753,500
丸文	15,800	811.00	12,813,800
ハピネット	15,000	2,029.00	30,435,000
橋本総業ホールディングス	7,000	991.00	6,937,000
日本ライフライン	56,900	998.00	56,786,200
タカショー	15,400	671.00	10,333,400
I D O M	60,000	744.00	44,640,000
進和	11,700	2,002.00	23,423,400
エスケイジャパン	4,800	497.00	2,385,600
ダイトロン	7,000	2,038.00	14,266,000
シークス	25,200	1,108.00	27,921,600
田中商事	6,100	546.00	3,330,600
オーハシテクニカ	9,700	1,406.00	13,638,200
白銅	6,400	2,388.00	15,283,200
ダイコー通産	2,400	1,119.00	2,685,600
伊藤忠商事	1,184,800	3,865.00	4,579,252,000
丸紅	1,712,000	1,311.00	2,244,432,000
高島	2,800	2,637.00	7,383,600
長瀬産業	90,400	2,043.00	184,687,200
蝶理	11,100	1,930.00	21,423,000
豊田通商	176,500	4,640.00	818,960,000

三共生興	25,400	477.00	12,115,800
兼松	68,400	1,485.00	101,574,000
ツカモトコーポレーション	3,300	1,165.00	3,844,500
三井物産	1,388,900	3,212.00	4,461,146,800
日本紙パルプ商事	9,400	4,600.00	43,240,000
カメイ	21,100	1,113.00	23,484,300
東都水産	1,000	4,540.00	4,540,000
OUGホールディングス	2,900	2,383.00	6,910,700
スターゼン	13,400	2,105.00	28,207,000
山善	71,300	908.00	64,740,400
椿本興業	3,200	3,890.00	12,448,000
住友商事	1,169,400	1,891.50	2,211,920,100
内田洋行	7,800	4,450.00	34,710,000
三菱商事	1,295,800	4,076.00	5,281,680,800
第一実業	7,600	3,935.00	29,906,000
キャノンマーケティングジャパン	40,800	3,155.00	128,724,000
西華産業	8,500	1,572.00	13,362,000
佐藤商事	13,600	1,177.00	16,007,200
菱洋エレクトロ	11,700	2,177.00	25,470,900
東京産業	16,100	806.00	12,976,600
ユアサ商事	15,900	3,690.00	58,671,000
神鋼商事	4,400	3,905.00	17,182,000
トルク	10,700	216.00	2,311,200
阪和興業	34,300	3,580.00	122,794,000
正栄食品工業	11,700	4,235.00	49,549,500
カナデン	16,100	1,085.00	17,468,500
菱電商事	15,700	1,604.00	25,182,800
岩谷産業	43,800	5,380.00	235,644,000
ナイス	6,100	1,330.00	8,113,000
ニチモウ	2,400	2,525.00	6,060,000
極東貿易	11,400	1,298.00	14,797,200
アステナホールディングス	30,600	414.00	12,668,400
三愛オブリ	44,300	1,250.00	55,375,000
稲畑産業	39,600	2,424.00	95,990,400
G S I クレオス	9,500	1,427.00	13,556,500
明和産業	18,300	745.00	13,633,500
クワザワホールディングス	7,100	399.00	2,832,900
ワキタ	35,700	1,174.00	41,911,800
東邦ホールディングス	53,700	1,967.00	105,627,900
サンゲツ	48,000	1,577.00	75,696,000
ミツウロコグループホールディングス	22,700	1,017.00	23,085,900
シナネンホールディングス	6,500	4,075.00	26,487,500

伊藤忠エネクス	43,700	1,050.00	45,885,000
サンリオ	55,500	3,960.00	219,780,000
サンワテクノス	10,000	1,313.00	13,130,000
リョーサン	20,300	2,316.00	47,014,800
新光商事	26,100	928.00	24,220,800
トーホー	7,600	1,715.00	13,034,000
三信電気	8,100	1,830.00	14,823,000
東陽テクニカ	19,500	1,238.00	24,141,000
モスフードサービス	25,900	3,115.00	80,678,500
加賀電子	16,100	4,060.00	65,366,000
ソーダニッカ	15,800	569.00	8,990,200
立花エレテック	12,900	1,627.00	20,988,300
フォーバル	7,000	898.00	6,286,000
PALTAC	27,700	4,080.00	113,016,000
三谷産業	30,900	300.00	9,270,000
西本Wismettacホールディングス	4,500	4,375.00	19,687,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,800	1,657.00	2,982,600
コア商事ホールディングス	12,400	623.00	7,725,200
KPPグループホールディングス	36,600	835.00	30,561,000
ヤマタネ	8,500	1,620.00	13,770,000
丸紅建材リース	1,700	1,764.00	2,998,800
日鉄物産	12,100	5,150.00	62,315,000
泉州電業	4,400	5,520.00	24,288,000
トラスコ中山	37,000	2,011.00	74,407,000
オートバックスセブン	61,400	1,416.00	86,942,400
モリト	12,700	731.00	9,283,700
加藤産業	21,400	3,495.00	74,793,000
北恵	4,400	745.00	3,278,000
イエローハット	31,100	1,808.00	56,228,800
JKホールディングス	13,900	1,055.00	14,664,500
日伝	13,400	1,702.00	22,806,800
北沢産業	10,600	194.00	2,056,400
杉本商事	9,300	1,888.00	17,558,400
因幡電機産業	49,200	2,743.00	134,955,600
東テク	5,900	3,415.00	20,148,500
ミスミグループ本社	248,200	3,150.00	781,830,000
アルテック	11,000	288.00	3,168,000
タキヒヨー	5,400	797.00	4,303,800
蔵王産業	3,800	1,690.00	6,422,000
スズケン	70,800	3,180.00	225,144,000
ジェコス	13,700	799.00	10,946,300
グローセル	21,500	406.00	8,729,000

ローソン	43,800	4,715.00	206,517,000
サンエー	13,500	4,430.00	59,805,000
カワチ薬品	15,500	2,115.00	32,782,500
エービーシー・マート	30,900	6,690.00	206,721,000
ハードオフコーポレーション	9,000	1,262.00	11,358,000
アスクル	42,800	1,527.00	65,355,600
ゲオホールディングス	24,000	1,957.00	46,968,000
アダストリア	21,400	1,982.00	42,414,800
くら寿司	20,700	3,280.00	67,896,000
キャンドウ	6,400	2,200.00	14,080,000
アイケイ	7,000	423.00	2,961,000
パルグループホールディングス	17,400	2,162.00	37,618,800
エディオン	91,000	1,197.00	108,927,000
サーラコーポレーション	37,500	802.00	30,075,000
ワッツ	10,100	630.00	6,363,000
ハローズ	9,100	3,030.00	27,573,000
フジオフードグループ本社	14,700	1,390.00	20,433,000
あみやき亭	4,800	2,911.00	13,972,800
大黒天物産	6,400	4,260.00	27,264,000
ハニーズホールディングス	15,900	1,207.00	19,191,300
ファーマライズホールディングス	4,700	641.00	3,012,700
アルペン	14,700	2,005.00	29,473,500
ハブ	6,900	618.00	4,264,200
クオールホールディングス	24,500	1,232.00	30,184,000
ジinzホールディングス	10,500	4,380.00	45,990,000
ビックカメラ	117,500	1,220.00	143,350,000
D C Mホールディングス	117,700	1,147.00	135,001,900
Monotaro	250,000	2,240.00	560,000,000
東京一番フーズ	5,000	580.00	2,900,000
きちりホールディングス	5,300	335.00	1,775,500
アーランドサービスホールディングス	14,600	2,200.00	32,120,000
J．フロント リテイリング	219,400	1,249.00	274,030,600
ドトール・日レスホールディングス	31,400	1,703.00	53,474,200
マツキヨココカラ&カンパニー	115,800	5,820.00	673,956,000
ブロンコビリー	9,500	2,492.00	23,674,000
Z O Z O	136,000	3,020.00	410,720,000
トレジャー・ファクトリー	6,000	2,127.00	12,762,000
物語コーポレーション	9,800	6,900.00	67,620,000
三越伊勢丹ホールディングス	296,900	1,387.00	411,800,300
Hamee	7,500	899.00	6,742,500
マーケットエンタープライズ	2,300	1,015.00	2,334,500
ウエルシアホールディングス	104,600	3,200.00	334,720,000

クリエイトSDホールディングス	29,200	3,220.00	94,024,000
丸善CHIホールディングス	24,100	320.00	7,712,000
ミサワ	4,600	575.00	2,645,000
ティーライフ	2,900	1,235.00	3,581,500
チムニー	6,000	1,134.00	6,804,000
シュッピン	16,300	1,453.00	23,683,900
オイシックス・ラ・大地	28,600	1,668.00	47,704,800
ネクステージ	40,300	2,661.00	107,238,300
ジョイフル本田	56,900	1,787.00	101,680,300
鳥貴族ホールディングス	6,700	2,172.00	14,552,400
ホットランド	13,700	1,395.00	19,111,500
すかいらーくホールディングス	241,100	1,585.00	382,143,500
SFPホールディングス	9,600	1,677.00	16,099,200
綿半ホールディングス	13,800	1,399.00	19,306,200
ヨシックスホールディングス	4,000	2,159.00	8,636,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	57,700	1,050.00	60,585,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,200	1,334.00	10,938,800
B E E N O S	10,100	2,346.00	23,694,600
あさひ	16,600	1,308.00	21,712,800
日本調剤	12,200	1,330.00	16,226,000
コスモス薬品	20,000	14,760.00	295,200,000
トーエル	9,100	756.00	6,879,600
セブン&アイ・ホールディングス	662,700	5,693.00	3,772,751,100
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	132,600	904.00	119,870,400
ツルハホールディングス	43,200	8,780.00	379,296,000
サンマルクホールディングス	15,800	1,644.00	25,975,200
フェリシモ	4,700	996.00	4,681,200
トリドールホールディングス	49,400	2,874.00	141,975,600
T O K Y O B A S E	19,200	323.00	6,201,600
ウイルプラスホールディングス	4,000	1,046.00	4,184,000
J Mホールディングス	15,200	1,703.00	25,885,600
サツドラホールディングス	9,400	696.00	6,542,400
アレンザホールディングス	13,500	997.00	13,459,500
串カツ田中ホールディングス	4,900	1,860.00	9,114,000
パロックジャパンリミテッド	14,100	783.00	11,040,300
クスリのアオキホールディングス	17,700	7,130.00	126,201,000
力の源ホールディングス	10,500	821.00	8,620,500
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	101,400	2,439.00	247,314,600
メディカルシステムネットワーク	18,000	402.00	7,236,000
はるやまホールディングス	10,100	417.00	4,211,700

ノジマ	64,200	1,243.00	79,800,600
カップ・クリエイト	27,700	1,394.00	38,613,800
ライトオン	14,800	603.00	8,924,400
良品計画	227,700	1,360.00	309,672,000
パリミキホールディングス	25,800	254.00	6,553,200
アドヴァングループ	17,200	867.00	14,912,400
アルビス	5,900	2,369.00	13,977,100
コナカ	21,300	336.00	7,156,800
ハウス オブ ローゼ	2,600	1,613.00	4,193,800
G - 7ホールディングス	22,200	1,541.00	34,210,200
イオン北海道	26,200	1,193.00	31,256,600
コジマ	34,500	632.00	21,804,000
ヒマラヤ	6,500	914.00	5,941,000
コーナン商事	28,200	3,000.00	84,600,000
エコス	6,700	1,795.00	12,026,500
ワタミ	23,900	915.00	21,868,500
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	395,300	2,595.00	1,025,803,500
西松屋チェーン	39,300	1,375.00	54,037,500
ゼンショーホールディングス	96,600	3,735.00	360,801,000
幸楽苑ホールディングス	11,500	1,057.00	12,155,500
ハークスレイ	9,000	487.00	4,383,000
サイゼリヤ	29,400	2,706.00	79,556,400
V Tホールディングス	75,100	480.00	36,048,000
魚力	5,600	2,044.00	11,446,400
フジ・コーポレーション	10,200	1,270.00	12,954,000
ユナイテッドアローズ	20,900	2,001.00	41,820,900
ハイデイ日高	28,700	1,914.00	54,931,800
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	13,100	216.00	2,829,600
コロワイド	81,200	1,821.00	147,865,200
ピーシーデボコーポレーション	24,100	285.00	6,868,500
壱番屋	14,000	4,490.00	62,860,000
P L A N T	5,100	632.00	3,223,200
スギホールディングス	39,500	6,170.00	243,715,000
薬王堂ホールディングス	10,000	2,716.00	27,160,000
スクロール	30,900	694.00	21,444,600
ヨンドシーホールディングス	16,900	1,741.00	29,422,900
木曽路	26,800	2,202.00	59,013,600
S R Sホールディングス	29,400	896.00	26,342,400
千趣会	33,300	395.00	13,153,500
リテールパートナーズ	26,500	1,189.00	31,508,500
ケーヨー	36,800	893.00	32,862,400

上新電機	19,400	1,911.00	37,073,400
日本瓦斯	94,600	2,137.00	202,160,200
ロイヤルホールディングス	33,900	2,367.00	80,241,300
いなげや	19,800	1,124.00	22,255,200
チヨダ	17,300	732.00	12,663,600
ライフコーポレーション	15,500	2,282.00	35,371,000
リンガーハット	22,700	2,099.00	47,647,300
MrMaxHD	25,200	677.00	17,060,400
AOKIホールディングス	38,700	736.00	28,483,200
オークワ	28,400	917.00	26,042,800
コメリ	30,600	2,703.00	82,711,800
青山商事	38,000	1,048.00	39,824,000
しまむら	23,000	12,500.00	287,500,000
はせがわ	11,300	433.00	4,892,900
高島屋	133,000	1,921.00	255,493,000
松屋	33,400	1,140.00	38,076,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	86,000	1,298.00	111,628,000
近鉄百貨店	5,800	2,585.00	14,993,000
丸井グループ	143,100	2,493.00	356,748,300
アクシアル リテイリング	13,200	3,455.00	45,606,000
イオン	651,900	2,796.00	1,822,712,400
イズミ	31,300	3,035.00	94,995,500
平和堂	29,600	1,882.00	55,707,200
フジ	43,400	1,811.00	78,597,400
ヤオコー	22,500	6,380.00	143,550,000
ゼビオホールディングス	27,200	1,023.00	27,825,600
ケーズホールディングス	168,500	1,182.00	199,167,000
Olympicグループ	9,400	515.00	4,841,000
日産東京販売ホールディングス	30,300	256.00	7,756,800
シルバーライフ	4,300	1,426.00	6,131,800
Genky DrugStores	8,800	3,765.00	33,132,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,800	820.00	3,936,000
ブックオフグループホールディングス	11,800	1,223.00	14,431,400
ギフトホールディングス	3,800	3,115.00	11,837,000
アインホールディングス	24,300	6,370.00	154,791,000
元気寿司	5,600	3,345.00	18,732,000
ヤマダホールディングス	699,800	484.00	338,703,200
アーケランズ	31,100	1,576.00	49,013,600
ニトリホールディングス	78,500	12,170.00	955,345,000
グルメ杵屋	16,000	1,016.00	16,256,000
愛眼	14,400	176.00	2,534,400
ケーユーホールディングス	10,600	1,177.00	12,476,200

吉野家ホールディングス	69,100	2,302.00	159,068,200	
松屋フーズホールディングス	9,600	3,990.00	38,304,000	
サガミホールディングス	28,600	1,227.00	35,092,200	
関西フードマーケット	16,200	1,415.00	22,923,000	
王将フードサービス	13,100	6,420.00	84,102,000	
プレナス	22,300	2,635.00	58,760,500	
ミニストップ	14,800	1,418.00	20,986,400	
アークス	35,200	1,994.00	70,188,800	
パローホールディングス	40,500	1,739.00	70,429,500	
ベルク	8,800	5,580.00	49,104,000	
大庄	10,900	1,039.00	11,325,100	
ファーストリテイリング	26,400	84,230.00	2,223,672,000	
サンドラッグ	74,400	3,600.00	267,840,000	
サクスパー ホールディングス	19,100	759.00	14,496,900	
ヤマザワ	4,400	1,161.00	5,108,400	
やまや	4,200	2,486.00	10,441,200	
ペルーナ	42,900	722.00	30,973,800	
いよぎんホールディングス	221,900	721.00	159,989,900	
しずおかフィナンシャルグループ	407,800	931.00	379,661,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	139,300	894.00	124,534,200	
島根銀行	6,300	412.00	2,595,600	
じもとホールディングス	13,100	427.00	5,593,700	
めぶきフィナンシャルグループ	814,100	293.00	238,531,300	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,900	2,226.00	50,975,400	
九州フィナンシャルグループ	346,400	386.00	133,710,400	
ゆうちょ銀行	467,200	994.00	464,396,800	
富山第一銀行	44,000	424.00	18,656,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	979,600	466.00	456,493,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	103,900	771.00	80,106,900	
三十三フィナンシャルグループ	15,900	1,475.00	23,452,500	
第四北越フィナンシャルグループ	27,900	2,671.00	74,520,900	
ひろぎんホールディングス	253,000	622.00	157,366,000	
おきなわフィナンシャルグループ	16,700	2,057.00	34,351,900	
十六フィナンシャルグループ	23,000	2,479.00	57,017,000	
北國フィナンシャルホールディングス	16,300	4,865.00	79,299,500	
プロクレアホールディングス	20,100	2,213.00	44,481,300	
あいちフィナンシャルグループ	26,500	1,880.00	49,820,000	
新生銀行	129,100	2,321.00	299,641,100	
あおぞら銀行	110,500	2,560.00	282,880,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,584,100	693.00	8,027,781,300	
りそなホールディングス	2,094,100	574.30	1,202,641,630	
三井住友トラスト・ホールディングス	327,300	4,299.00	1,407,062,700	

三井住友フィナンシャルグループ	1,284,300	4,105.00	5,272,051,500	
千葉銀行	558,900	828.00	462,769,200	
群馬銀行	318,400	406.00	129,270,400	
武蔵野銀行	25,300	1,733.00	43,844,900	
千葉興業銀行	42,600	293.00	12,481,800	
筑波銀行	77,100	195.00	15,034,500	
七十七銀行	52,500	1,820.00	95,550,000	
秋田銀行	11,800	1,644.00	19,399,200	
山形銀行	18,200	1,033.00	18,800,600	
岩手銀行	12,100	1,800.00	21,780,000	
東邦銀行	141,600	207.00	29,311,200	
東北銀行	8,900	946.00	8,419,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	142,900	2,626.00	375,255,400	
スルガ銀行	173,500	390.00	67,665,000	
八十二銀行	367,100	489.00	179,511,900	
山梨中央銀行	19,900	1,069.00	21,273,100	
大垣共立銀行	33,900	1,762.00	59,731,800	
福井銀行	15,800	1,364.00	21,551,200	
清水銀行	7,100	1,438.00	10,209,800	
富山銀行	3,100	1,581.00	4,901,100	
滋賀銀行	32,200	2,586.00	83,269,200	
南都銀行	26,700	2,170.00	57,939,000	
百五銀行	166,200	331.00	55,012,200	
京都銀行	61,400	5,530.00	339,542,000	
紀陽銀行	58,700	1,457.00	85,525,900	
ほくほくフィナンシャルグループ	112,300	892.00	100,171,600	
山陰合同銀行	110,000	709.00	77,990,000	
鳥取銀行	6,300	1,087.00	6,848,100	
百十四銀行	17,700	1,685.00	29,824,500	
四国銀行	26,100	868.00	22,654,800	
阿波銀行	26,300	1,898.00	49,917,400	
大分銀行	10,600	1,821.00	19,302,600	
宮崎銀行	10,700	2,231.00	23,871,700	
佐賀銀行	10,400	1,559.00	16,213,600	
琉球銀行	43,000	772.00	33,196,000	
セブン銀行	587,700	272.00	159,854,400	
みずほフィナンシャルグループ	2,372,800	1,621.50	3,847,495,200	
高知銀行	6,200	633.00	3,924,600	
山口フィナンシャルグループ	197,600	797.00	157,487,200	
長野銀行	6,100	1,234.00	7,527,400	
名古屋銀行	12,100	3,095.00	37,449,500	
北洋銀行	248,600	236.00	58,669,600	

大光銀行	5,900	1,166.00	6,879,400	
愛媛銀行	25,800	858.00	22,136,400	
トマト銀行	6,000	972.00	5,832,000	
京葉銀行	82,600	496.00	40,969,600	
栃木銀行	88,800	305.00	27,084,000	
北日本銀行	5,800	1,885.00	10,933,000	
東和銀行	32,400	523.00	16,945,200	
福島銀行	20,900	213.00	4,451,700	
大東銀行	8,700	613.00	5,333,100	
トモニホールディングス	142,800	317.00	45,267,600	
フィデアホールディングス	18,100	1,304.00	23,602,400	
池田泉州ホールディングス	210,100	219.00	46,011,900	
F P G	66,800	1,173.00	78,356,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,600	1,319.00	17,938,400	
マーキュリアホールディングス	11,100	611.00	6,782,100	
S B Iホールディングス	244,600	2,618.00	640,362,800	
ジャフコ グループ	68,600	2,272.00	155,859,200	
大和証券グループ本社	1,271,400	576.00	732,326,400	
野村ホールディングス	3,022,100	481.40	1,454,838,940	
岡三証券グループ	143,400	333.00	47,752,200	
丸三証券	59,300	419.00	24,846,700	
東洋証券	60,900	232.00	14,128,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	195,500	349.00	68,229,500	
光世証券	4,700	378.00	1,776,600	
水戸証券	49,500	233.00	11,533,500	
いちよし証券	33,100	600.00	19,860,000	
松井証券	97,200	777.00	75,524,400	
マネックスグループ	167,100	483.00	80,709,300	
極東証券	22,800	646.00	14,728,800	
岩井コスモホールディングス	18,900	1,251.00	23,643,900	
アイザワ証券グループ	27,000	682.00	18,414,000	
マネーパートナーズグループ	22,000	280.00	6,160,000	
スパークス・グループ	18,400	1,356.00	24,950,400	
かんぽ生命保険	199,200	2,145.00	427,284,000	
S O M P Oホールディングス	281,600	6,084.00	1,713,254,400	
アニコム ホールディングス	60,800	583.00	35,446,400	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	406,800	3,922.00	1,595,469,600	
第一生命ホールディングス	963,800	2,318.00	2,234,088,400	
東京海上ホールディングス	1,652,100	2,651.00	4,379,717,100	
T & Dホールディングス	440,300	1,374.00	604,972,200	
アドバンスクリエイト	9,500	984.00	9,348,000	
全国保証	47,300	4,830.00	228,459,000	

あんしん保証	10,200	253.00	2,580,600
イントラスト	9,400	656.00	6,166,400
日本モーゲージサービス	11,700	843.00	9,863,100
C a s a	7,700	830.00	6,391,000
アルヒ	29,600	1,395.00	41,292,000
プレミアグループ	30,400	1,568.00	47,667,200
ネットプロテクションズホールディングス	61,800	423.00	26,141,400
クレディセゾン	115,900	1,623.00	188,105,700
芙蓉総合リース	17,100	8,370.00	143,127,000
みずほリース	24,600	3,205.00	78,843,000
東京センチュリー	30,800	4,920.00	151,536,000
日本証券金融	78,500	843.00	66,175,500
アイフル	333,600	393.00	131,104,800
リコーリース	17,700	3,630.00	64,251,000
イオンフィナンシャルサービス	108,100	1,440.00	155,664,000
アコム	392,300	321.00	125,928,300
ジャックス	19,800	3,630.00	71,874,000
オリエントコーポレーション	54,000	1,160.00	62,640,000
オリックス	1,176,100	2,105.50	2,476,278,550
三菱HCキャピタル	640,600	637.00	408,062,200
九州リースサービス	9,500	601.00	5,709,500
日本取引所グループ	461,300	1,962.00	905,070,600
イー・ギャランティ	29,700	2,372.00	70,448,400
アサックス	11,300	577.00	6,520,100
NECキャピタルソリューション	8,300	2,084.00	17,297,200
大東建託	64,500	14,400.00	928,800,000
いちご	226,900	334.00	75,784,600
日本駐車場開発	204,200	265.00	54,113,000
スター・マイカ・ホールディングス	8,800	1,416.00	12,460,800
SREホールディングス	5,700	3,490.00	19,893,000
ADワークスグループ	44,300	167.00	7,398,100
ヒューリック	384,600	1,074.00	413,060,400
三栄建築設計	9,200	1,558.00	14,333,600
野村不動産ホールディングス	103,100	3,425.00	353,117,500
三重交通グループホールディングス	44,200	520.00	22,984,000
サムティ	27,000	2,319.00	62,613,000
ディア・ライフ	28,200	618.00	17,427,600
地主	13,500	2,025.00	27,337,500
プレサンスコーポレーション	22,900	1,498.00	34,304,200
ハウスコム	5,600	971.00	5,437,600
JPMC	10,300	1,016.00	10,464,800
サンセイランディック	7,700	847.00	6,521,900

フージャースホールディングス	25,300	794.00	20,088,200
オープンハウスグループ	60,500	5,130.00	310,365,000
東急不動産ホールディングス	540,700	783.00	423,368,100
飯田グループホールディングス	162,700	2,102.00	341,995,400
イーランド	4,100	1,632.00	6,691,200
ムゲンエステート	16,500	472.00	7,788,000
A n d D oホールディングス	9,800	867.00	8,496,600
シーアールイー	8,900	1,307.00	11,632,300
ケイアイスター不動産	9,400	4,565.00	42,911,000
グッドコムアセット	8,900	1,665.00	14,818,500
ジェイ・エス・ビー	4,600	3,925.00	18,055,000
ロードスターキャピタル	8,300	1,725.00	14,317,500
テンポイノベーション	7,700	910.00	7,007,000
フェイスネットワーク	4,000	1,339.00	5,356,000
パーク24	128,900	2,026.00	261,151,400
パラカ	6,900	1,891.00	13,047,900
三井不動産	773,000	2,876.50	2,223,534,500
三菱地所	1,128,000	1,928.00	2,174,784,000
平和不動産	32,000	4,120.00	131,840,000
東京建物	157,300	2,081.00	327,341,300
京阪神ビルディング	27,500	1,251.00	34,402,500
住友不動産	356,500	3,473.00	1,238,124,500
テーオーシー	32,400	755.00	24,462,000
東京楽天地	3,300	4,195.00	13,843,500
スターツコーポレーション	27,700	2,616.00	72,463,200
フジ住宅	26,200	629.00	16,479,800
空港施設	23,600	560.00	13,216,000
明和地所	12,600	607.00	7,648,200
ゴールドクレスト	16,800	1,751.00	29,416,800
エスリード	8,900	1,747.00	15,548,300
日神グループホールディングス	36,900	427.00	15,756,300
日本エスコン	36,800	833.00	30,654,400
M I R A R T Hホールディングス	82,900	395.00	32,745,500
A V A N T I A	11,800	785.00	9,263,000
イオンモール	100,500	1,644.00	165,222,000
毎日コムネット	9,800	654.00	6,409,200
ファースト住建	9,200	1,099.00	10,110,800
カチタス	49,700	3,100.00	154,070,000
トーセイ	28,800	1,377.00	39,657,600
穴吹興産	5,300	1,960.00	10,388,000
サンフロンティア不動産	29,100	1,165.00	33,901,500
F Jネクストホールディングス	21,500	1,016.00	21,844,000

インテリックス	4,500	541.00	2,434,500
ランドビジネス	6,700	223.00	1,494,100
サンネクスタグループ	8,100	961.00	7,784,100
グランディハウス	17,100	551.00	9,422,100
日本空港ビルデング	64,200	6,580.00	422,436,000
明豊ファシリティワークス	9,300	672.00	6,249,600
日本工営	12,300	3,440.00	42,312,000
L I F U L L	60,900	166.00	10,109,400
M I X I	44,000	2,285.00	100,540,000
ジェイエシーリクルートメント	15,600	2,443.00	38,110,800
日本M&Aセンターホールディングス	314,900	1,718.00	540,998,200
メンバーズ	5,100	2,690.00	13,719,000
中広	4,000	426.00	1,704,000
UTグループ	27,800	2,184.00	60,715,200
アイティメディア	9,300	1,701.00	15,819,300
E・Jホールディングス	11,300	1,259.00	14,226,700
夢真ビーネックスグループ	62,800	1,674.00	105,127,200
コシダカホールディングス	51,600	1,057.00	54,541,200
アルトナー	5,000	980.00	4,900,000
パソナグループ	21,000	1,981.00	41,601,000
C D S	5,000	1,789.00	8,945,000
リンクアンドモチベーション	49,300	865.00	42,644,500
エス・エム・エス	65,300	3,135.00	204,715,500
サニーサイドアップグループ	7,300	575.00	4,197,500
パーソルホールディングス	191,800	2,922.00	560,439,600
リニカル	11,300	767.00	8,667,100
クックパッド	48,700	203.00	9,886,100
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,900	626.00	6,197,400
学情	8,000	1,438.00	11,504,000
スタジオアリス	8,800	2,098.00	18,462,400
シミックホールディングス	9,700	1,683.00	16,325,100
エプコ	4,600	654.00	3,008,400
N J S	3,900	2,018.00	7,870,200
総合警備保障	70,000	3,780.00	264,600,000
カカクコム	140,800	2,536.00	357,068,800
アイロムグループ	7,000	2,658.00	18,606,000
セントケア・ホールディング	12,900	829.00	10,694,100
サイネックス	3,900	571.00	2,226,900
ルネサンス	13,700	957.00	13,110,900
ディップ	33,800	3,935.00	133,003,000
デジタルホールディングス	13,700	1,167.00	15,987,900
新日本科学	23,500	2,782.00	65,377,000

キャリアデザインセンター	4,200	1,480.00	6,216,000
ベネフィット・ワン	69,600	2,135.00	148,596,000
エムスリー	338,500	4,213.00	1,426,100,500
ツカダ・グローバルホールディング	12,200	395.00	4,819,000
アウトソーシング	102,400	1,110.00	113,664,000
ウェルネット	17,500	650.00	11,375,000
ワールドホールディングス	7,800	2,618.00	20,420,400
ディー・エヌ・エー	73,200	1,879.00	137,542,800
博報堂D Yホールディングス	243,000	1,244.00	302,292,000
ぐるなび	28,800	447.00	12,873,600
タカミヤ	24,200	395.00	9,559,000
ジャパンベストレスキューシステム	10,600	785.00	8,321,000
ファンコミュニケーションズ	34,400	436.00	14,998,400
ライク	6,600	1,902.00	12,553,200
ビジネス・ブレークスルー	8,000	400.00	3,200,000
エスプール	49,600	911.00	45,185,600
WDBホールディングス	8,900	2,445.00	21,760,500
ティア	12,000	427.00	5,124,000
C D G	2,300	1,215.00	2,794,500
アドウェイズ	24,100	744.00	17,930,400
バリューコマース	13,100	2,257.00	29,566,700
インフォマート	178,600	445.00	79,477,000
J Pホールディングス	50,500	313.00	15,806,500
エコナックホールディングス	37,200	92.00	3,422,400
C Lホールディングス	5,200	855.00	4,446,000
プレステージ・インターナショナル	72,500	633.00	45,892,500
アミューズ	10,700	1,752.00	18,746,400
ドリームインキュベータ	6,100	2,093.00	12,767,300
クイック	12,100	1,931.00	23,365,100
T A C	12,200	202.00	2,464,400
電通グループ	179,800	4,550.00	818,090,000
イオンファンタジー	7,500	3,245.00	24,337,500
シーティーエス	22,100	774.00	17,105,400
ネクシィーズグループ	6,400	666.00	4,262,400
H . U . グループホールディングス	50,200	2,746.00	137,849,200
アルプス技研	15,100	1,982.00	29,928,200
日本空調サービス	20,600	745.00	15,347,000
オリエンタルランド	203,900	19,695.00	4,015,810,500
ダスキン	41,400	2,908.00	120,391,200
明光ネットワークジャパン	23,200	610.00	14,152,000
ファルコホールディングス	8,600	1,741.00	14,972,600
ラウンドワン	161,200	653.00	105,263,600

リゾートトラスト	81,300	2,377.00	193,250,100
ビー・エム・エル	24,500	3,400.00	83,300,000
りらいあコミュニケーションズ	28,700	977.00	28,039,900
リゾー教育	88,800	298.00	26,462,400
早稲田アカデミー	11,000	1,165.00	12,815,000
ユー・エス・エス	214,800	2,215.00	475,782,000
東京個別指導学院	17,600	524.00	9,222,400
サイバーエージェント	410,000	1,242.00	509,220,000
楽天グループ	792,300	641.00	507,864,300
クリーク・アンド・リバー社	10,200	2,018.00	20,583,600
モーニングスター	34,400	454.00	15,617,600
テー・オー・ダブリュー	37,800	308.00	11,642,400
山田コンサルティンググループ	10,200	1,196.00	12,199,200
セントラルスポーツ	7,300	2,435.00	17,775,500
フルキャストホールディングス	16,500	2,849.00	47,008,500
エン・ジャパン	34,200	2,484.00	84,952,800
リソルホールディングス	2,200	4,515.00	9,933,000
テクノプロ・ホールディングス	114,900	3,345.00	384,340,500
アトラグループ	4,300	189.00	812,700
インターワークス	6,500	376.00	2,444,000
アイ・アールジャパンホールディングス	9,100	2,160.00	19,656,000
K e e P e r 技研	12,400	3,815.00	47,306,000
ファーストロジック	3,400	800.00	2,720,000
三機サービス	3,800	931.00	3,537,800
G u n o s y	11,100	671.00	7,448,100
デザインワン・ジャパン	7,800	225.00	1,755,000
イー・ガーディアン	6,600	2,993.00	19,753,800
リブセンス	10,200	286.00	2,917,200
ジャパンマテリアル	59,200	1,835.00	108,632,000
ベクトル	27,200	1,075.00	29,240,000
ウチヤマホールディングス	10,700	288.00	3,081,600
チャーム・ケア・コーポレーション	14,600	1,044.00	15,242,400
キャリアリンク	7,200	2,413.00	17,373,600
I B J	10,900	982.00	10,703,800
アサンテ	8,700	1,609.00	13,998,300
バリューHR	15,200	1,519.00	23,088,800
M & A キャピタルパートナーズ	15,900	3,685.00	58,591,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,800	1,015.00	7,917,000
E R I ホールディングス	5,700	1,083.00	6,173,100
アピスト	3,100	2,879.00	8,924,900
シグマクシス・ホールディングス	23,400	1,170.00	27,378,000
ウィルグループ	14,500	1,402.00	20,329,000

エスクロー・エージェント・ジャパン	22,300	146.00	3,255,800
メドピア	13,700	1,501.00	20,563,700
レアジョブ	4,100	908.00	3,722,800
リクルートホールディングス	1,373,600	4,397.00	6,039,719,200
エラン	23,000	1,080.00	24,840,000
土木管理総合試験所	9,200	302.00	2,778,400
日本郵政	2,095,200	990.30	2,074,876,560
ベルシステム24ホールディングス	27,800	1,409.00	39,170,200
鎌倉新書	22,300	817.00	18,219,100
S MN	5,100	504.00	2,570,400
グローバルキッズCOMPANY	3,500	589.00	2,061,500
エアトリ	11,200	2,656.00	29,747,200
アトラエ	13,700	1,529.00	20,947,300
ストライク	8,500	3,930.00	33,405,000
ソラスト	47,600	889.00	42,316,400
セラク	6,500	1,149.00	7,468,500
インソース	21,400	2,865.00	61,311,000
ベйкаレント・コンサルティング	13,600	36,750.00	499,800,000
Orchestra Holdings	3,800	2,451.00	9,313,800
アイモバイル	9,200	1,165.00	10,718,000
キャリアインデックス	7,500	413.00	3,097,500
MS - Japan	8,200	823.00	6,748,600
船場	3,700	770.00	2,849,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	61,000	1,741.00	106,201,000
フルテック	3,000	1,091.00	3,273,000
GameWith	6,700	368.00	2,465,600
MS&Consulting	3,400	610.00	2,074,000
ウェルビー	13,000	971.00	12,623,000
エル・ティー・エス	2,300	3,105.00	7,141,500
ミダックホールディングス	8,800	3,595.00	31,636,000
日総工産	15,600	573.00	8,938,800
キュービーネットホールディングス	9,200	1,276.00	11,739,200
RPAホールディングス	28,300	316.00	8,942,800
スプリックス	6,900	957.00	6,603,300
マネジメントソリューションズ	9,500	2,958.00	28,101,000
プロレド・パートナーズ	5,000	519.00	2,595,000
テノ・ホールディングス	3,000	567.00	1,701,000
フロンティア・マネジメント	6,000	1,205.00	7,230,000
ピアラ	3,700	671.00	2,482,700
コプロ・ホールディングス	4,200	889.00	3,733,800
ギークス	3,800	810.00	3,078,000
カーブスホールディングス	53,100	864.00	45,878,400

フォーラムエンジニアリング	12,100	915.00	11,071,500
Fast Fitness Japan	3,800	1,429.00	5,430,200
ダイレクトマーケティングミックス	19,700	1,670.00	32,899,000
ポピンズ	2,800	1,559.00	4,365,200
LITALICO	15,700	2,790.00	43,803,000
アドバンテッジリスクマネジメント	10,600	414.00	4,388,400
リログループ	105,000	2,146.00	225,330,000
東祥	14,600	1,163.00	16,979,800
ビーウィズ	5,400	1,127.00	6,085,800
TREホールディングス	36,300	1,595.00	57,898,500
人・夢・技術グループ	7,800	2,671.00	20,833,800
エイチ・アイ・エス	45,000	2,161.00	97,245,000
ラックランド	5,400	2,753.00	14,866,200
共立メンテナンス	34,300	6,290.00	215,747,000
イチネンホールディングス	19,900	1,266.00	25,193,400
建設技術研究所	8,900	3,045.00	27,100,500
スペース	12,900	886.00	11,429,400
燦ホールディングス	8,500	1,792.00	15,232,000
スバル興業	1,200	8,540.00	10,248,000
東京テアトル	7,000	1,120.00	7,840,000
タナベコンサルティンググループ	8,000	610.00	4,880,000
ナガワ	5,400	7,030.00	37,962,000
東京都競馬	14,400	3,890.00	56,016,000
カナモト	31,600	2,136.00	67,497,600
西尾レントオール	16,000	3,015.00	48,240,000
トランス・コスモス	24,400	3,495.00	85,278,000
乃村工藝社	82,500	1,091.00	90,007,500
藤田観光	7,600	3,165.00	24,054,000
KNT-CTホールディングス	11,900	1,777.00	21,146,300
日本管財	20,700	2,495.00	51,646,500
トーカイ	15,400	1,849.00	28,474,600
セコム	189,000	8,595.00	1,624,455,000
セントラル警備保障	9,400	2,573.00	24,186,200
丹青社	36,700	832.00	30,534,400
メイテック	68,400	2,425.00	165,870,000
応用地質	16,800	2,203.00	37,010,400
船井総研ホールディングス	36,100	2,577.00	93,029,700
進学会ホールディングス	7,500	304.00	2,280,000
オオバ	12,500	687.00	8,587,500
いであ	4,400	1,529.00	6,727,600
学究社	6,400	1,638.00	10,483,200
ベネッセホールディングス	64,100	2,145.00	137,494,500

イオンディライト	22,200	2,926.00	64,957,200	
ナック	9,500	920.00	8,740,000	
ダイセキ	35,000	4,365.00	152,775,000	
ステップ	7,200	1,885.00	13,572,000	
合 計	205,464,700		486,014,972,030	

(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10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	718,249,749
国債証券	514,981,986,650
地方債証券	32,789,541,640
特殊債券	37,162,796,577
社債券	28,983,727,400
未収入金	100,176,000
未収利息	818,380,623
前払費用	13,048,744
流動資産合計	615,567,907,383
資産合計	615,567,907,383
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	200,330
未払金	100,000,000
未払解約金	130,245,254
未払利息	1,391
流動負債合計	230,446,975
負債合計	230,446,975
純資産の部	
元本等	
元本	455,690,246,332
剰余金	
剰余金又は欠損金()	159,647,214,076
元本等合計	615,337,460,408

	2022年10月20日現在
項目	金額（円）
純資産合計	615,337,460,408
負債純資産合計	615,567,907,383

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年10月20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> <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>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10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	455,690,246,332口
2. 担保資産	<p>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。</p> <p>有価証券 99,678,000円</p>
3. 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 1.3503円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,503円)</p>

(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10月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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10月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 4月21日
期首元本額	449,683,563,005円
期中追加設定元本額	20,199,059,814円
期中一部解約元本額	14,192,376,487円
期末元本額	455,690,246,332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）	4,174,444,647円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,022,136円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,685,925,792円
世界経済インデックスファンド	4,185,774,597円
D C マイセレクション 2 5	26,077,546,181円
D C マイセレクション 5 0	29,997,640,743円
D C マイセレクション 7 5	8,805,264,236円
D C 日本債券インデックス・オープン	433,313,020円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,008,363,436円
D C 日本債券インデックス・オープン P	66,880,334,903円
D C マイセレクション S 2 5	13,345,668,127円
D C マイセレクション S 5 0	14,889,758,493円
D C マイセレクション S 7 5	3,415,257,625円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	690,278,369円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,350,911,327円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	889,196,211円
D C 世界経済インデックスファンド	3,546,191,449円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,391,166円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	28,912,078円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	7,397,367円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	979,351円

区分	2022年10月20日現在
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	80,067,364円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	115,059,134円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	32,797,792円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	25,805,048円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,666,118,036円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	740,264,703円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,079,025,721円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	69,941,070円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	52,505,106円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	956,545,084円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,081,935,269円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,387,778,543円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	135,900,333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	16,477,246,696円
分散投資コア戦略ファンドA	19,751,030,398円
分散投資コア戦略ファンドS	24,502,705,590円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	177,294,789円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,452,928,384円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	73,108,218円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	36,908,401円
SMT インデックスバランス・オープン	61,794,077円
SMT 世界経済インデックス・オープン	41,633,136円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	82,391,051円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	129,408,504円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,981,291円
グローバル経済コア	233,815,671円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	34,692,692円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	21,003,683円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	36,955,588円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	20,401,356円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	5,212,320円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	3,765,691円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	14,624,584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)	83,611,240,382円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	91,461,191円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	16,639,030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)	374,346,910円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		15,154,998,600
地方債証券		552,197,670
特殊債券		616,176,777
社債券		544,717,980
合計		16,868,091,027

(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)

債券関連

(2022年10月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	148,090,000	-	147,890,000	200,000
	合計	148,090,000	-	147,890,000	200,000

(注)1.時価の算定方法

債券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.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.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

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430回利付国債(2年)	930,000,000	931,004,400	
	第432回利付国債(2年)	1,550,000,000	1,551,472,500	
	第433回利付国債(2年)	1,910,000,000	1,911,699,900	
	第434回利付国債(2年)	1,915,000,000	1,916,685,200	
	第435回利付国債(2年)	2,730,000,000	2,732,347,800	
	第436回利付国債(2年)	720,000,000	720,597,600	

第437回利付国債（2年）	2,390,000,000	2,391,912,000	
第438回利付国債（2年）	370,000,000	370,247,900	
第439回利付国債（2年）	470,000,000	470,291,400	
第440回利付国債（2年）	1,930,000,000	1,931,061,500	
第138回利付国債（5年）	6,890,000,000	6,904,813,500	
第139回利付国債（5年）	5,590,000,000	5,602,577,500	
第140回利付国債（5年）	4,660,000,000	4,670,811,200	
第141回利付国債（5年）	7,650,000,000	7,668,283,500	
第142回利付国債（5年）	4,370,000,000	4,381,318,300	
第143回利付国債（5年）	4,750,000,000	4,763,157,500	
第144回利付国債（5年）	5,230,000,000	5,245,323,900	
第145回利付国債（5年）	5,270,000,000	5,286,126,200	
第146回利付国債（5年）	4,120,000,000	4,133,019,200	
第147回利付国債（5年）	4,170,000,000	4,168,540,500	
第148回利付国債（5年）	6,770,000,000	6,762,553,000	
第149回利付国債（5年）	4,820,000,000	4,810,552,800	
第150回利付国債（5年）	7,050,000,000	7,030,965,000	
第151回利付国債（5年）	4,000,000,000	3,985,920,000	
第152回利付国債（5年）	210,000,000	210,136,500	
第153回利付国債（5年）	5,090,000,000	5,065,160,800	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	486,832,000	
第2回利付国債（40年）	1,130,000,000	1,320,857,000	
第3回利付国債（40年）	550,000,000	644,820,000	
第4回利付国債（40年）	950,000,000	1,112,383,500	
第5回利付国債（40年）	1,070,000,000	1,202,487,400	
第6回利付国債（40年）	1,260,000,000	1,381,111,200	
第7回利付国債（40年）	1,240,000,000	1,298,490,800	
第8回利付国債（40年）	1,490,000,000	1,446,462,200	
第9回利付国債（40年）	2,050,000,000	1,451,195,000	
第10回利付国債（40年）	2,100,000,000	1,752,366,000	
第11回利付国債（40年）	1,525,000,000	1,225,673,000	
第12回利付国債（40年）	1,290,000,000	923,162,700	
第13回利付国債（40年）	2,120,000,000	1,505,539,200	
第14回利付国債（40年）	2,130,000,000	1,612,559,100	
第15回利付国債（40年）	1,010,000,000	836,239,600	
第332回利付国債（10年）	4,600,000,000	4,636,708,000	
第333回利付国債（10年）	3,320,000,000	3,350,942,400	
第334回利付国債（10年）	4,260,000,000	4,305,369,000	
第335回利付国債（10年）	2,310,000,000	2,333,215,500	
第336回利付国債（10年）	1,210,000,000	1,223,612,500	
第337回利付国債（10年）	2,800,000,000	2,819,376,000	
第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	4,605,600,000	

第339回利付国債(10年)	4,670,000,000	4,720,996,400	
第340回利付国債(10年)	4,430,000,000	4,482,274,000	
第341回利付国債(10年)	5,340,000,000	5,390,676,600	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,773,756,400	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,676,327,900	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,910,325,000	
第345回利付国債(10年)	3,780,000,000	3,784,687,200	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,753,737,500	
第347回利付国債(10年)	3,550,000,000	3,549,148,000	
第348回利付国債(10年)	4,460,000,000	4,454,514,200	
第349回利付国債(10年)	5,000,000,000	4,988,450,000	
第350回利付国債(10年)	6,390,000,000	6,369,424,200	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,940,000,000	4,919,202,600	
第352回利付国債(10年)	4,510,000,000	4,487,540,200	
第353回利付国債(10年)	5,415,000,000	5,383,647,150	
第354回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,756,661,600	
第355回利付国債(10年)	3,970,000,000	3,938,676,700	
第356回利付国債(10年)	4,280,000,000	4,240,666,800	
第357回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,742,660,100	
第358回利付国債(10年)	3,260,000,000	3,220,880,000	
第359回利付国債(10年)	3,360,000,000	3,312,120,000	
第360回利付国債(10年)	4,890,000,000	4,814,351,700	
第361回利付国債(10年)	4,600,000,000	4,524,836,000	
第362回利付国債(10年)	3,750,000,000	3,685,425,000	
第363回利付国債(10年)	5,070,000,000	4,978,030,200	
第364回利付国債(10年)	5,210,000,000	5,110,645,300	
第365回利付国債(10年)	6,600,000,000	6,485,094,000	
第366回利付国債(10年)	5,740,000,000	5,740,000,000	
第367回利付国債(10年)	5,360,000,000	5,337,220,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	129,330,300	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	184,907,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	138,192,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	132,829,400	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	57,993,000	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	414,981,000	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	213,120,000	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	398,671,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	263,827,200	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	170,937,600	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	293,664,800	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	222,615,400	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	464,672,000	

第14回利付国債(30年)	800,000,000	965,120,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	414,252,600
第16回利付国債(30年)	200,000,000	244,020,000
第17回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,391,764,500
第18回利付国債(30年)	345,000,000	413,937,900
第19回利付国債(30年)	530,000,000	636,784,400
第20回利付国債(30年)	480,000,000	588,960,000
第21回利付国債(30年)	500,000,000	601,500,000
第22回利付国債(30年)	540,000,000	664,048,800
第23回利付国債(30年)	430,000,000	529,489,100
第24回利付国債(30年)	780,000,000	960,460,800
第25回利付国債(30年)	600,000,000	723,708,000
第26回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,697,092,700
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,372,313,600
第28回利付国債(30年)	2,090,000,000	2,586,312,300
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,040,021,900
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,133,469,500
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,307,999,000
第32回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,636,732,800
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,099,697,600
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,128,241,750
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	2,648,979,000
第36回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,454,292,500
第37回利付国債(30年)	2,255,000,000	2,555,952,300
第38回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,571,896,200
第39回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,652,471,800
第40回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,379,376,000
第41回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,343,996,400
第42回利付国債(30年)	1,280,000,000	1,396,147,200
第43回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,405,725,900
第44回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,382,572,800
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,510,344,000
第46回利付国債(30年)	1,700,000,000	1,780,631,000
第47回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,736,879,100
第48回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,781,725,200
第49回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,635,760,000
第50回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,538,589,600
第51回利付国債(30年)	1,640,000,000	1,305,423,600
第52回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,391,978,400
第53回利付国債(30年)	1,320,000,000	1,123,240,800
第54回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,528,065,200
第55回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,274,587,200
第56回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,305,108,400

第57回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,238,727,300	
第58回利付国債(30年)	2,350,000,000	2,056,790,500	
第59回利付国債(30年)	1,380,000,000	1,174,338,600	
第60回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,405,710,200	
第61回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,222,843,000	
第62回利付国債(30年)	340,000,000	270,813,400	
第63回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,257,365,700	
第64回利付国債(30年)	1,790,000,000	1,375,525,500	
第65回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,079,616,050	
第66回利付国債(30年)	1,110,000,000	852,135,900	
第67回利付国債(30年)	1,865,000,000	1,501,604,750	
第68回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,197,855,700	
第69回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,105,848,400	
第70回利付国債(30年)	2,270,000,000	1,869,118,000	
第71回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,174,773,600	
第72回利付国債(30年)	1,150,000,000	942,586,000	
第73回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,532,278,000	
第74回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,541,988,000	
第75回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,279,726,800	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	225,088,600	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	337,250,100	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	133,597,100	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	196,062,900	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	401,895,000	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	416,240,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	207,454,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	655,647,300	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	375,742,800	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	209,180,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	136,631,300	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	282,468,600	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	304,091,100	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	178,647,900	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	284,455,800	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	232,364,000	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	412,795,500	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	636,822,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	309,270,500	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	499,741,600	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	310,613,200	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	549,729,000	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,966,316,700	

第 8 8 回利付国債(20年)	420,000,000	454,801,200
第 8 9 回利付国債(20年)	350,000,000	377,720,000
第 9 0 回利付国債(20年)	630,000,000	682,787,700
第 9 1 回利付国債(20年)	450,000,000	489,465,000
第 9 2 回利付国債(20年)	880,000,000	954,175,200
第 9 3 回利付国債(20年)	410,000,000	444,501,500
第 9 4 回利付国債(20年)	610,000,000	664,009,400
第 9 5 回利付国債(20年)	610,000,000	672,128,500
第 9 6 回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,737,186,300
第 9 7 回利付国債(20年)	900,000,000	991,467,000
第 9 8 回利付国債(20年)	440,000,000	482,565,600
第 9 9 回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,419,632,100
第 1 0 0 回利付国債(20年)	480,000,000	532,814,400
第 1 0 1 回利付国債(20年)	715,000,000	801,343,400
第 1 0 2 回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,417,991,400
第 1 0 3 回利付国債(20年)	400,000,000	447,912,000
第 1 0 4 回利付国債(20年)	160,000,000	177,369,600
第 1 0 5 回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,312,974,200
第 1 0 6 回利付国債(20年)	380,000,000	425,049,000
第 1 0 7 回利付国債(20年)	760,000,000	848,699,600
第 1 0 8 回利付国債(20年)	870,000,000	960,932,400
第 1 0 9 回利付国債(20年)	520,000,000	575,952,000
第 1 1 0 回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,232,286,000
第 1 1 1 回利付国債(20年)	970,000,000	1,096,837,200
第 1 1 2 回利付国債(20年)	790,000,000	888,110,100
第 1 1 3 回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,277,893,400
第 1 1 4 回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,638,026,000
第 1 1 5 回利付国債(20年)	700,000,000	797,475,000
第 1 1 6 回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,701,401,200
第 1 1 7 回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,225,368,000
第 1 1 8 回利付国債(20年)	660,000,000	745,437,000
第 1 1 9 回利付国債(20年)	530,000,000	590,653,200
第 1 2 0 回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,726,105,100
第 1 2 1 回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,687,500,000
第 1 2 2 回利付国債(20年)	940,000,000	1,050,224,400
第 1 2 3 回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,140,794,700
第 1 2 4 回利付国債(20年)	610,000,000	693,466,300
第 1 2 5 回利付国債(20年)	1,770,000,000	2,047,571,400
第 1 2 6 回利付国債(20年)	730,000,000	832,492,000
第 1 2 7 回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,154,833,800
第 1 2 8 回利付国債(20年)	970,000,000	1,101,037,300
第 1 2 9 回利付国債(20年)	740,000,000	833,721,000
第 1 3 0 回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,451,099,100

第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,120,580,000	
第132回利付国債(20年)	660,000,000	741,747,600	
第133回利付国債(20年)	730,000,000	826,922,100	
第134回利付国債(20年)	430,000,000	488,359,600	
第135回利付国債(20年)	630,000,000	709,745,400	
第136回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,173,312,000	
第137回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,195,987,400	
第138回利付国債(20年)	620,000,000	687,927,200	
第139回利付国債(20年)	830,000,000	928,703,600	
第140回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,731,744,400	
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,806,688,000	
第142回利付国債(20年)	980,000,000	1,116,180,800	
第143回利付国債(20年)	1,920,000,000	2,149,190,400	
第144回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,275,787,000	
第145回利付国債(20年)	2,675,000,000	3,021,359,000	
第146回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,049,542,000	
第147回利付国債(20年)	2,250,000,000	2,515,680,000	
第148回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,268,837,500	
第149回利付国債(20年)	2,460,000,000	2,720,587,800	
第150回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,767,364,600	
第151回利付国債(20年)	2,445,000,000	2,615,758,800	
第152回利付国債(20年)	2,840,000,000	3,035,051,200	
第153回利付国債(20年)	2,630,000,000	2,839,979,200	
第154回利付国債(20年)	2,655,000,000	2,830,654,800	
第155回利付国債(20年)	2,650,000,000	2,755,788,000	
第156回利付国債(20年)	2,310,000,000	2,220,949,500	
第157回利付国債(20年)	2,950,000,000	2,750,609,500	
第158回利付国債(20年)	2,560,000,000	2,477,798,400	
第159回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,426,134,400	
第160回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,028,741,500	
第161回利付国債(20年)	2,070,000,000	2,014,337,700	
第162回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,221,532,200	
第163回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,338,712,200	
第164回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,195,828,200	
第165回利付国債(20年)	2,150,000,000	2,031,922,000	
第166回利付国債(20年)	1,790,000,000	1,736,532,700	
第167回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,069,178,800	
第168回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,522,801,000	
第169回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,787,199,100	
第170回利付国債(20年)	2,240,000,000	2,001,552,000	
第171回利付国債(20年)	1,720,000,000	1,530,163,600	
第172回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,171,410,000	

	第173回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,108,255,500
	第174回利付国債（20年）	2,800,000,000	2,501,044,000
	第175回利付国債（20年）	2,030,000,000	1,840,012,300
	第176回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,473,151,400
	第177回利付国債（20年）	2,340,000,000	2,065,564,800
	第178回利付国債（20年）	2,120,000,000	1,901,470,400
	第179回利付国債（20年）	2,935,000,000	2,625,093,350
	第180回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,274,341,100
	第181回利付国債（20年）	1,690,000,000	1,619,645,300
	国債証券合計	511,000,000,000	514,981,986,650
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	99,669,000
	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	103,116,000
	第5回東京都公募公債（東京グリーンボンド（30年））	100,000,000	80,764,000
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	104,583,000
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	119,828,000
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	116,574,000
	第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	112,253,000
	第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	109,449,000
	第16回東京都公募公債（20年）	200,000,000	220,452,000
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	110,710,000
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,672,000
	第19回東京都公募公債（30年）	100,000,000	81,081,000
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	224,092,000
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	223,690,000
	第33回東京都公募公債（5年）	200,000,000	199,336,000
	第726回東京都公募公債	200,000,000	201,644,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	100,729,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,803,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,087,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	99,884,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	297,819,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	196,016,000
	第830回東京都公募公債	300,000,000	295,002,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,283,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,782,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,172,000
	平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	198,358,000
	第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	247,210,000
	第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	111,446,000
	第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	223,722,000
	第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	112,993,000

第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	111,731,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,976,000	
第78回神奈川県公募公債（5年）	200,000,000	199,766,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	201,558,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	101,047,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,252,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,021,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,884,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	195,946,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	223,872,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	223,792,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	112,007,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,879,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	152,233,670	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,175,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,148,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,688,000	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,754,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,334,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	99,167,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	155,808,000	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	177,155,160	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	194,612,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	112,396,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	111,693,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,203,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	93,464,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	96,157,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	137,009,980	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	110,420,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	101,141,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,978,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,850,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,772,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	452,376,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	100,856,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	94,424,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	295,170,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	103,175,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	85,770,000	

第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	111,842,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,897,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,981,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,930,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,022,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,950,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	304,345,600	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	112,651,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,922,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,904,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,847,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,704,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,046,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	286,728,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,485,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	84,484,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	195,820,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,967,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	160,756,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	111,906,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	224,218,000	
平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	100,713,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,638,837	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,862,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	382,839,600	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	110,228,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	111,440,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	90,227,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	225,452,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	188,996,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	223,722,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	187,622,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	100,857,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,121,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,666,000	

平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,254,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,907,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	97,647,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	97,516,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	145,732,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	110,359,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	110,468,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	104,794,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	113,074,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	105,385,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	115,387,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,752,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	106,114,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,106,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	84,484,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	94,929,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	294,192,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	97,593,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	93,276,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	222,880,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	112,262,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	111,842,000	
平成25年度第8回千葉県公募公債	300,000,000	302,124,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	100,790,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,783,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	101,159,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,667,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,973,600	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	293,481,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	97,932,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	293,856,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	200,000,000	197,606,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	221,998,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	99,802,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,697,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,822,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,826,000	

第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,586,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,084,160	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,979,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,943,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,893,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,736,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,532,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,338,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,944,928	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,186,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,896,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,801,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,410,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,200,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	398,412,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,490,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,978,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,237,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,766,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,493,655	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,877,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,377,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,490,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	195,902,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	197,268,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,852,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,892,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	224,860,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	80,033,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	282,108,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	96,915,000	
平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	100,931,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	195,282,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	121,133,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	121,617,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	110,589,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	108,178,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,131,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	294,087,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	199,956,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	130,497,600	
	200,000,000	223,222,000	

平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）			
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	113,225,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	112,145,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	79,940,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	80,205,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	105,504,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	335,751,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,957,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,116,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,542,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,875,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	215,444,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	294,213,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	97,639,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	105,601,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,734,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	110,991,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,917,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	97,591,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,750,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,146,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,786,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	112,049,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	109,482,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	201,830,000	
平成30年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	99,988,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	151,260,000	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,784,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,933,850	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	169,660,000	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	539,423,500	
令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	199,466,000	
令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	195,654,000	
令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	294,126,000	
令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	98,575,000	
平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	100,967,000	
平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	201,066,000	

	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	98,834,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	110,128,000	
	地方債証券合計	32,211,430,000	32,789,541,640	
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	99,731,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,854,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,888,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	68,840,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,058,000	
	第21回道路債券	100,000,000	121,619,000	
	第27回道路債券	400,000,000	413,188,000	
	第28回道路債券	200,000,000	245,928,000	
	第33回道路債券	200,000,000	248,508,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,922,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,507,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,506,000	
	第42回道路債券	100,000,000	105,035,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,750,000	
	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	119,828,000	
	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	224,276,000	
	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	226,258,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,550,000	
	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	117,615,000	
	第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,822,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,845,000	
	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	113,704,000	
	第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,810,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,024,000		
第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,705,000		
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,746,000		

第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,439,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,416,000	
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	112,223,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	571,032,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,841,000	
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	267,793,500	
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	201,656,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	86,644,000	
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	538,074,160	
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	302,673,000	
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	218,946,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	102,993,480	
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	101,010,000	
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	100,987,000	
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	216,778,000	
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	100,970,000	
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	100,874,000	
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	301,740,000	
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	105,468,000	
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	212,168,000	
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	201,504,000	
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	100,167,000	
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	80,294,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,364,420	
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	204,606,400	
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	99,889,000	
	200,000,000	199,684,000	

第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	99,782,000	
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	119,726,400	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,782,000	
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	284,901,000	
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	213,349,440	
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	98,030,000	
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	97,783,000	
第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	116,918,400	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	355,101,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	104,875,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	367,578,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,012,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	244,894,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	41,233,200	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	120,564,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	223,598,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	219,522,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	600,000,000	599,454,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	157,126,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	108,755,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	223,934,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	111,733,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	551,110,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	105,763,350	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	706,034,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,874,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,945,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,571,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,840,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,841,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,158,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,346,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,936,000	

第 8 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,746,000	
第 8 3 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,424,000	
第 8 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,491,000	
第 9 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,731,000	
第 9 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	250,663,660	
F 9 5 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,799,000	
第 9 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,858,000	
第 9 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,808,000	
第 1 0 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,754,700	
F 1 0 7 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,048,000	
第 1 1 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	155,496,120	
第 1 1 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,698,000	
第 1 1 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,589,000	
第 1 1 9 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,263,000	
第 1 2 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,960,000	
F 1 3 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,653,000	
F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,960,000	
F 2 0 2 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,478,000	
F 2 0 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,858,000	
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,300,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,108,000	
F 4 4 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,640,000	
第 2 9 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,198,000	
第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	104,863,000	
第 2 7 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,695,000	
第 1 9 回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,440,000	
第 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	111,971,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	113,684,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,679,960	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,858,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,819,800	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	186,388,510	
第 5 4 回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,760,200	
第 8 7 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,766,000	
第 8 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,900,000	
第 8 9 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,761,000	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	204,808,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	132,068,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	72,989,000	

第171回都市再生債券	200,000,000	153,874,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,469,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	97,743,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,076,000	10,143,811	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,191,000	10,274,158	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	123,033,000	121,778,063	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,819,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	85,120,000	84,196,448	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	109,011,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,167,000	10,242,845	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,019,000	11,174,037	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	150,933,000	148,992,001	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,857,000	11,004,763	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	173,454,000	170,890,349	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	61,892,000	61,094,212	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,351,000	11,567,236	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	210,735,000	207,133,538	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	145,474,000	143,137,687	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,431,000	11,667,507	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,078,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,154,000	15,822,442	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,134,000	15,843,179	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,223,000	18,142,019	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,989,000	19,919,461	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,746,000	21,874,789	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,155,000	22,274,099	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,922,000	46,128,641	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,942,000	10,019,845	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,945,000	20,883,013	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,148,000	10,212,439	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,301,000	21,244,996	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,948,000	20,907,698	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,809,000	19,668,947	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,043,000	11,228,964	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,826,000	41,419,040	

第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,906,000	21,757,710	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,675,000	10,821,247	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,874,000	28,960,807	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,579,000	27,609,467	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,789,000	27,849,308	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,388,000	60,546,020	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,998,000	74,156,500	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,251,000	38,320,103	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,033,000	39,441,361	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,314,000	39,776,062	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,658,000	34,853,868	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,859,000	33,776,751	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,346,000	39,849,546	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	169,684,500	
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,837,000	102,631,437	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,904,000	138,640,840	
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,876,000	39,847,900	
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,287,000	41,310,289	
第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,097,000	42,011,408	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,968,000	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,299,000	133,092,610	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,686,000	45,461,748	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,144,000	95,009,183	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,532,000	53,158,181	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,219,000	56,669,876	
第 9 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	317,589,000	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,625,000	56,344,787	
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,758,000	175,551,496	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,486,000	118,168,057	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,502,000	57,195,844	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,140,000	61,837,607	
第 1 0 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,382,000	65,991,235	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,060,000	71,733,961	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,656,000	71,144,755	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,065,000	71,830,932	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,656,000	72,706,574	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,977,000	72,880,660	
	75,716,000	74,487,129	

第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,172,000	74,992,857	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,113,000	74,718,609	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,128,000	74,724,960	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,863,000	75,458,712	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,812,000	152,588,249	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,888,000	75,434,047	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,452,000	154,739,102	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,204,000	76,691,534	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,534,000	153,168,519	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,081,000	77,500,170	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,330,000	155,810,400	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,730,000	157,126,433	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,091,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,947,000	79,514,238	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,725,000	79,471,340	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,925,000	78,980,372	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,676,000	161,880,731	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,650,000	81,127,952	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,867,000	80,489,545	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,248,000	163,109,706	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,420,000	82,194,540	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	257,997,000	246,885,069	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,288,000	165,753,437	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,124,000	85,442,386	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,895,000	85,934,796	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,826,000	177,955,515	

第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,212,000	89,594,101	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,790,000	179,453,264	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,258,000	180,500,765	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,646,000	90,024,118	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,620,000	182,057,141	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,652,000	182,773,048	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,342,000	91,774,010	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,872,000	92,567,292	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	287,403,000	277,427,241	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,240,000	92,996,712	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,637,000	95,547,568	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,519,000	96,464,878	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,412,000	97,486,389	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,766,000	195,373,145	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	91,014,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	80,470,000	
第65回日本学生支援債券	200,000,000	199,886,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	105,060,000	
第24回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	599,796,000	
い第823号商工債	200,000,000	200,188,000	
い第829号商工債	200,000,000	199,982,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,670,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,798,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,598,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,667,000	
い第850号商工債	200,000,000	199,178,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	99,974,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,410,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,487,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,340,000	
第385回信金中金債（5年）	100,000,000	99,109,000	
第254号商工債（3年）	300,000,000	299,718,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,990,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	111,272,000	

	第53回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,964,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,704,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	196,236,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	488,100,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,849,000	
	第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	598,326,000	
	第63回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,808,000	
	第66回西日本高速道路株式会社社債	800,000,000	799,424,000	
	第70回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,760,000	
	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,709,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,455,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	190,686,000	
	特殊債券合計	36,665,656,000	37,162,796,577	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,714,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	298,353,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,594,000	
	第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	98,820,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,577,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,888,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,577,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,044,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,824,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,222,000	
	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	199,754,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,535,000	
	第8回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,105,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,948,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	97,240,000	
	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	100,046,000	
	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	199,778,000	
	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	100,082,000	
	第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,915,000	
	第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,064,000	

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	299,295,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,840,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,218,000	
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	98,745,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,155,000	
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	199,196,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,721,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,529,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,747,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,532,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,071,000	
第13回JSR株式会社無担保社債	100,000,000	99,817,000	
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	99,260,000	
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	198,214,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,738,000	
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	99,174,000	
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	87,879,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,170,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,732,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,904,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	197,664,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	288,270,000	
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	99,852,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,977,000	
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	98,550,000	
第19回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	88,822,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,618,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,407,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,822,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,011,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,582,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,827,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,115,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	99,827,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,616,000	

第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,793,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,500,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,727,000	
第14回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	99,479,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,498,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	105,354,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,015,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,360,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,822,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	97,919,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,636,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,550,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	97,296,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,265,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,715,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,842,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,523,000	
第22回JA三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,500,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,482,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	195,538,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,778,000	
第8回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	94,029,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,382,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	88,001,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,939,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,469,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	111,903,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	196,494,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,324,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,207,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,611,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	99,587,000	
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	97,867,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	99,499,000	
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	113,813,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	108,671,000	
	100,000,000	100,720,000	

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）			
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,623,000	
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	301,908,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,110,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,290,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	196,460,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,461,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,580,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,582,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,644,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,823,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,898,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,747,000	
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	99,234,000	
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	98,832,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,120,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,734,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,493,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,787,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,015,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,888,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,620,000	
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	199,908,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	198,294,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,203,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,846,000	
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	99,078,000	
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	98,407,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,352,000	
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,104,000	
	200,000,000	198,612,000	

第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債			
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,702,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,538,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	89,433,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,463,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,072,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,077,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	96,525,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,231,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,823,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	98,569,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,436,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,471,000	
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	101,844,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,194,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	79,068,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,808,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,785,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,167,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	222,580,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,931,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	91,156,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	84,392,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,662,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	81,075,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	88,188,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	75,379,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,514,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,415,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	80,417,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	89,130,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	498,200,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	87,972,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,891,000	

第7 1 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,517,000	
第7 2 回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,671,000	
第3 1 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	84,113,000	
第3 7 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	71,843,000	
第4 0 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	64,938,000	
第5 4 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	77,150,000	
第5 6 回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	85,731,000	
第5 3 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	158,594,000	
第6 回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,372,000	
第2 0 回K D D I 株式会社無担保社債	100,000,000	100,764,000	
第2 5 回K D D I 株式会社無担保社債	100,000,000	99,089,000	
第1 1 回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	395,736,000	
第3 1 回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	176,570,000	
第3 3 回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	92,402,000	
第3 6 回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,728,000	
第5 0 7 回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,465,000	
第5 1 1 回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,940,000	
第5 1 9 回中部電力株式会社社債	100,000,000	95,131,000	
第5 4 0 回中部電力株式会社社債	100,000,000	86,437,000	
第5 6 2 回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,899,000	
第5 0 8 回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,123,000	
第5 1 0 回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,336,000	
第5 1 1 回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,691,000	
第5 2 4 回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,270,000	
第5 3 6 回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,349,000	
第5 3 8 回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,815,000	
第5 5 0 回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,794,000	
第5 5 4 回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,840,000	
第3 9 8 回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,281,000	
第4 0 0 回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,777,000	
第4 1 6 回中国電力株式会社社債	200,000,000	194,396,000	
第4 2 5 回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,432,000	
第3 0 7 回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,059,000	
第3 2 2 回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,155,000	
第3 3 0 回北陸電力株式会社社債	200,000,000	194,210,000	
第4 7 1 回東北電力株式会社社債	126,000,000	127,436,400	
第4 9 6 回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,801,000	
第5 0 8 回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,964,000	
第5 2 1 回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,080,000	
第5 2 7 回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,602,000	
第5 3 5 回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,011,000	

第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,753,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,246,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,548,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,952,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,231,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	193,580,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	96,762,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,026,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,094,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,537,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	92,073,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	93,491,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,122,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,993,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,132,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	197,450,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,698,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	297,606,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,022,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,686,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,224,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	271,803,000	
第55回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,782,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	97,275,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	80,772,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	194,798,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	194,082,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	87,889,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	199,092,000	
社債券合計	29,626,000,000	28,983,727,400	
合計		613,918,052,267	

(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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2022年10月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	13,763,896,628
コール・ローン	201,655,840
株式	528,680,823,030
投資信託受益証券	239,791,201
投資証券	11,777,473,023
派生商品評価勘定	70,039,001
未収入金	137,360,924
未収配当金	373,014,136
前払金	1,009,322,972
差入委託証拠金	2,543,801,358
流動資産合計	558,797,178,113
資産合計	558,797,178,113
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,078,764,772
未払解約金	50,845,643
未払利息	390
流動負債合計	1,129,610,805
負債合計	1,129,610,805
純資産の部	
元本等	
元本	128,443,161,093
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	429,224,406,215
元本等合計	557,667,567,308
純資産合計	557,667,567,308
負債純資産合計	558,797,178,113

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

	2022年10月20日現在
	<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。</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>

	2022年10月20日現在

(貸借対照表に関する注記)

	2022年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	128,443,161,093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) 4.3417円 (43,417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10月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	2022年10月20日現在
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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 4月21日
期首元本額	123,929,377,953円
期中追加設定元本額	10,600,744,655円
期中一部解約元本額	6,086,961,515円
期末元本額	128,443,161,093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）	1,871,654,846円

区分	2022年10月20日現在
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,478,216円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	33,210,223,952円
世界経済インデックスファンド	11,576,563,826円
外国株式インデックス・オープン	898,537,020円
D C マイセレクション 2 5	798,483,430円
D C マイセレクション 5 0	3,656,755,223円
D C マイセレクション 7 5	4,387,421,146円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,171,284,495円
D C マイセレクション S 2 5	407,325,731円
D C マイセレクション S 5 0	1,867,032,084円
D C マイセレクション S 7 5	1,616,745,984円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	35,699,994円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	151,128,296円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	112,412,093円
D C 世界経済インデックスファンド	10,035,714,270円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,318,139,835円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,323,750円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	3,459,609円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	26,236,485円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	11,726,106円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	43,653,881円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	11,125,147円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	30,002,904円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	236,248,614円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	162,191,662円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	1,188,684,790円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	94,145,833円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	23,141,895円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	150,376,080円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	49,107,538円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	988,111,586円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,066,302,292円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,135,185,104円
コア投資戦略ファンド（安定型）	517,915,994円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,225,767,643円
分散投資コア戦略ファンド A	1,480,175,803円
分散投資コア戦略ファンド S	8,275,998,160円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,380,425,465円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,136,409,982円
コア投資戦略ファンド（切替型）	514,894,453円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	584,422,094円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	28,963,546円
S M T インデックスバランス・オープン	157,107,314円

区分	2022年10月20日現在
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	358,342,252円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	16,378,823,368円
SMT 世界経済インデックス・オープン	212,074,967円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	819,852,001円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	149,245,281円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,244,187円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	297,890,913円
グローバル経済コア	641,339,505円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,146,193円
DCターゲット・イヤーフンド2055	5,497,868円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	456,682,822円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	83,967,079円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	52,870,164円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	45,818,136円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	17,742,606円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	21,892,772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）	242,007,276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）	173,715,019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）	824,108,082円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,343,762,944円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	218,864,822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）	84,904,553円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	75,033,700円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	70,144,430円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	219,879,354円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	223,719,705円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	222,566,542円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	214,996,816円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	212,832,396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）	109,473,077円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	61,859,590,952
投資信託受益証券	73,346,311
投資証券	3,390,289,275
合計	65,323,226,538

(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10月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	17,740,844,910	-	16,731,521,938	1,009,322,972
合計		17,740,844,910	-	16,731,521,938	1,009,322,972

(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10月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	114,876,300	-	115,472,588	596,288
	アメリカドル	114,876,300	-	115,472,588	596,288
	売建	54,720,800	-	54,719,887	913
	アメリカドル	54,720,800	-	54,719,887	913
合計		169,597,100	-	170,192,475	597,201

(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	41.91	1,159,691.61	
	BAKER HUGHES CO	75,948	25.65	1,948,066.20	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	170.75	3,114,992.25	
	CHEVRON CORP	153,061	168.00	25,714,248.00	
	CONOCOPHILLIPS	105,873	121.11	12,822,279.03	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	30.12	1,927,680.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	71.94	3,615,416.64	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	146.03	1,937,380.01	
	EOG RESOURCES INC	47,936	130.07	6,235,035.52	
	EQT CORPORATION	27,026	42.21	1,140,767.46	
	EXXON MOBIL	343,717	103.79	35,674,387.43	
	HALLIBURTON CO	71,583	31.96	2,287,792.68	
	HESS CORP	22,781	129.00	2,938,749.00	
	KINDER MORGAN INC	168,208	17.99	3,026,061.92	
	MARATHON OIL CORP	57,281	28.35	1,623,916.35	
	MARATHON PETROLEUM CORP	45,012	108.87	4,900,456.44	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	77,357	68.46	5,295,860.22	
	ONEOK INC	35,533	55.14	1,959,289.62	
	PHILLIPS 66	38,237	97.95	3,745,314.15	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,998	250.55	4,759,948.90	
	SCHLUMBERGER	112,526	45.47	5,116,557.22	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	67.12	1,161,041.76	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	2,092.83	1,115,478.39	
	VALERO ENERGY CORP	32,597	123.96	4,040,724.12	
	WILLIAMS COS	98,553	30.88	3,043,316.64	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,324	241.45	4,424,329.80	
	ALBEMARLE CORP	9,440	256.51	2,421,454.40	
	ALCOA CORP	15,500	37.62	583,110.00	
	AMCOR PLC	126,534	11.06	1,399,466.04	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	171.27	1,136,890.26	
	BALL CORP	25,605	48.94	1,253,108.70	
	CELANESE CORP-SERIES A	8,582	92.59	794,607.38	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	100.66	1,663,607.82	
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	14.82	637,260.00		
CORTEVA INC	58,500	61.80	3,615,300.00		
CROWN HOLDINGS INC	9,940	83.08	825,815.20		
DOW INC	60,585	45.13	2,734,201.05		
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	54.10	2,217,018.00		
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	73.14	810,025.50		

ECOLAB INC	21,208	145.73	3,090,641.84
FMC CORP	10,507	116.67	1,225,851.69
FREEMPORT-MCMORAN INC	119,600	28.36	3,391,856.00
INT'L PAPER CO	30,800	32.56	1,002,848.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,024	92.55	1,945,771.20
LINDE PLC	41,106	283.91	11,670,404.46
LYONDELLBASELL INDU-CL A	21,835	79.00	1,724,965.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,192	313.34	1,626,861.28
MOSAIC CO/THE	27,732	50.72	1,406,567.04
NEWMONT CORPORATION	65,704	40.37	2,652,470.48
NUCOR CORP	22,299	121.89	2,718,025.11
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	114.40	879,392.80
PPG INDUSTRIES INC	19,278	114.64	2,210,029.92
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	89.61	936,962.16
SEALED AIR CORP	11,690	47.63	556,794.70
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	207.24	4,086,565.56
STEEL DYNAMICS INC	15,552	80.68	1,254,735.36
VULCAN MATERIALS CO	10,247	154.77	1,585,928.19
WESTLAKE CORP	4,100	91.96	377,036.00
WESTROCK CO	21,356	32.47	693,429.32
3 M COMPANY	46,618	114.20	5,323,775.60
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	49.80	548,049.00
ALLEGION PLC	7,601	92.11	700,128.11
AMETEK INC	19,255	117.99	2,271,897.45
BOEING CO	46,285	138.39	6,405,381.15
CARLISLE COS INC	4,378	285.96	1,251,932.88
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	34.89	2,378,032.62
CATERPILLAR	43,701	184.41	8,058,901.41
CUMMINS INC	11,214	224.76	2,520,458.64
DEERE&CO	23,765	371.32	8,824,419.80
DOVER CORP	12,041	121.36	1,461,295.76
EATON CORP	32,650	139.00	4,538,350.00
EMERSON ELECTRIC CO	48,687	81.20	3,953,384.40
FASTENAL CO	47,949	46.08	2,209,489.92
FORTIVE CORP	28,348	60.67	1,719,873.16
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	55.01	567,153.10
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	110.30	574,773.30
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	239.37	4,540,848.90
GENERAL ELECTRIC CO	89,763	70.53	6,330,984.39
GRAINGER (WW) INC	3,667	521.13	1,910,983.71
HEICO CORP	3,640	148.96	542,214.40
HEICO CORP-CLASS A	6,449	118.19	762,207.31

HONEYWELL INTL INC	55,841	179.28	10,011,174.48
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	34.24	1,081,778.56
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	243.14	856,339.08
IDEX CORP	5,916	204.06	1,207,218.96
ILLINOIS TOOL WORKS	25,708	191.95	4,934,650.60
INGERSOLL-RAND INC	31,562	46.31	1,461,636.22
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	49.75	631,825.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	52.41	2,971,070.49
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	237.61	3,726,675.24
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	216.54	546,980.04
LOCKHEED MARTIN CORP	19,579	439.96	8,613,976.84
MASCO CORP	19,462	46.35	902,063.70
NORDSON CORP	4,121	216.76	893,267.96
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,122	510.91	6,193,251.02
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	66.28	2,244,108.24
OWENS CORNING	8,642	83.99	725,841.58
PACCAR INC	28,106	90.74	2,550,338.44
PARKER HANNIFIN CORP	10,579	265.58	2,809,570.82
PENTAIR PLC	14,533	40.13	583,209.29
PLUG POWER INC	41,884	16.95	709,933.80
QUANTA SERVICES INC	11,465	132.57	1,519,915.05
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	121,485	87.63	10,645,730.55
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	233.93	2,128,295.14
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	40.17	555,470.76
SMITH (A.O.) CORP	9,016	50.77	457,742.32
SNAP-ON INC	4,000	213.70	854,800.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	74.09	933,385.82
TEXTRON	16,934	61.84	1,047,198.56
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	145.14	2,705,119.32
TRANSDIGM GROUP INC	4,347	541.50	2,353,900.50
UNITED RENTALS INC	6,022	286.85	1,727,410.70
WABTEC CORP	15,024	87.10	1,308,590.40
XYLEM INC	15,077	92.90	1,400,653.30
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	98.62	1,120,717.68
CINTAS CORP	7,423	400.25	2,971,055.75
CLARIVATE PLC	27,357	8.92	244,024.44
COPART INC	16,617	110.95	1,843,656.15
COSTAR GROUP INC	32,116	72.29	2,321,665.64
EQUIFAX INC	9,509	160.12	1,522,581.08
JACOBS SOLUTIONS INC	10,661	114.15	1,216,953.15
LEIDOS HOLDINGS	11,220	93.19	1,045,591.80
REPUBLIC SERVICES INC	18,296	133.98	2,451,298.08

ROBERT HALF INTL INC	9,566	80.83	773,219.78
ROLLINS INC	17,468	36.88	644,219.84
TRANSUNION	15,741	55.95	880,708.95
VERISK ANALYTICS INC	13,315	169.36	2,255,028.40
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	132.13	2,811,065.75
WASTE MANAGEMENT INC	33,891	161.50	5,473,396.50
AMERCO	734	536.49	393,783.66
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	93.45	960,385.65
CSX CORP	179,261	27.92	5,004,967.12
DELTA AIR LINES INC	14,609	32.52	475,084.68
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	91.01	1,298,894.72
FEDEX CORP	20,314	152.96	3,107,229.44
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	2.38	197,566.18
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	167.96	1,184,453.92
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,697	49.42	676,905.74
LYFT INC-A	21,288	13.02	277,169.76
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	217.62	4,153,712.94
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	260.76	2,086,862.28
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	33.12	448,212.96
UBER TECHNOLOGIES INC	120,334	27.53	3,312,795.02
UNION PACIFIC CORP	51,838	200.06	10,370,710.28
UNITED PARCEL SERVICE B	59,627	165.79	9,885,560.33
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	23.51	168,684.25
APTIV PLC	22,415	85.95	1,926,569.25
BORGWARNER INC	19,781	34.07	673,938.67
FORD MOTOR COMPANY	321,972	12.13	3,905,520.36
GENERAL MOTORS CO	114,534	33.63	3,851,778.42
LEAR CORP	5,287	126.82	670,497.34
LUCID GROUP INC	31,234	12.64	394,797.76
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	26,935	31.50	848,452.50
TESLA INC	216,377	222.04	48,044,349.08
DR HORTON INC	27,764	67.79	1,882,121.56
GARMIN LTD	12,854	81.20	1,043,744.80
HASBRO INC	10,572	64.84	685,488.48
LENNAR CORP-CL A	20,844	72.29	1,506,812.76
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	296.87	2,762,375.35
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	94.95	395,276.85
NEWELL BRANDS INC	31,461	15.03	472,858.83
NIKE B	103,874	88.57	9,200,120.18
NVR INC	247	3,977.85	982,528.95
PULTE GROUP INC	21,609	37.16	802,990.44
VF CORP	25,718	28.45	731,677.10

WHIRLPOOL CORP	5,220	137.78	719,211.60
AIRBNB INC-CLASS A	31,141	116.87	3,639,448.67
ARAMARK	20,955	34.81	729,443.55
BOOKING HOLDINGS INC	3,339	1,771.82	5,916,106.98
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	37.31	655,163.60
CARNIVAL CORPORATION	84,361	7.68	647,892.48
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,303	1,527.21	3,517,164.63
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	133.00	1,424,696.00
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	323.40	921,043.20
EXPEDIA GROUP INC	11,638	96.12	1,118,644.56
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	128.70	2,815,698.60
LAS VEGAS SANDS CORP	29,096	35.60	1,035,817.60
MARRIOTT INTL A	22,091	149.99	3,313,429.09
MCDONALD'S CORP	60,458	250.75	15,159,843.50
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	32.46	937,250.04
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	46.69	782,851.23
STARBUCKS CORP	93,796	87.52	8,209,025.92
VAIL RESORTS INC	3,014	211.44	637,280.16
WYNN RESORTS LTD	9,302	54.48	506,772.96
YUM BRANDS INC	22,637	110.45	2,500,256.65
ACTIVISION BLIZZARD INC	64,558	72.21	4,661,733.18
ALPHABET INC-CL A	492,726	99.63	49,090,291.38
ALPHABET INC-CL C	460,933	100.29	46,226,970.57
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	6.11	233,951.90
CABLE ONE INC	445	779.90	347,055.50
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	324.65	3,184,491.85
COMCAST CORP-CL A	367,926	30.39	11,181,271.14
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	13.75	276,815.00
ELECTRONIC ARTS INC	23,158	123.84	2,867,886.72
FOX CORP - CLASS A	27,658	29.32	810,932.56
FOX CORP- CLASS B	10,345	27.66	286,142.70
IAC INC	6,721	48.37	325,094.77
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	28.49	963,930.66
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	75.11	846,339.48
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	59.50	915,050.50
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	40.41	548,929.44
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	40.68	259,701.12
LIVE NATION ENTERTAINMENT	14,491	79.62	1,153,773.42
MATCH GROUP INC	22,730	44.73	1,016,712.90
META PLATFORMS INC-CLASS A	187,450	133.23	24,973,963.50
NETFLIX INC	36,196	272.38	9,859,066.48
NEWS CORP-CLASS A	33,479	16.59	555,416.61

OMNICOM GROUP	16,538	68.41	1,131,364.58
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	19.08	927,020.88
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	23.04	1,054,471.68
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	41.44	1,162,764.96
ROKU INC	9,122	51.10	466,134.20
SEA LTD-ADR	28,338	47.92	1,357,956.96
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.14	371,273.52
SNAP INC - A	83,375	10.86	905,452.50
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	122.50	1,576,207.50
THE WALT DISNEY CO	149,471	98.99	14,796,134.29
TWITTER INC	54,209	51.83	2,809,652.47
WARNER BROS DISCOVERY INC	192,233	12.61	2,424,058.13
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	44.35	972,817.25
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	171.25	911,735.00
AMAZON.COM	749,309	115.07	86,222,986.63
AUTOZONE INC	1,639	2,289.80	3,752,982.20
BATH & BODY WORKS INC	19,806	32.91	651,815.46
BEST BUY COMPANY INC	18,175	63.74	1,158,474.50
BURLINGTON STORES INC	5,108	115.37	589,309.96
CARMAX INC	13,591	57.50	781,482.50
CHEWY INC - CLASS A	6,878	34.84	239,629.52
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	238.37	4,454,181.82
DOLLAR TREE INC	17,931	139.97	2,509,802.07
DOORDASH INC - A	15,171	45.78	694,528.38
EBAY	46,820	37.81	1,770,264.20
ETSY INC	10,294	94.33	971,033.02
GENUINE PARTS CO	11,319	158.97	1,799,381.43
HOME DEPOT	84,000	275.49	23,141,160.00
LKQ CORP	22,779	51.15	1,165,145.85
LOWES COMPANIES	52,525	183.94	9,661,448.50
MERCADOLIBRE INC	3,725	815.45	3,037,551.25
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	737.72	3,988,852.04
POOL CORP	3,304	298.12	984,988.48
ROSS STORES INC	28,076	83.66	2,348,838.16
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,926	155.39	5,893,321.14
TJX COMPANIES INC	97,454	66.10	6,441,709.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	196.32	1,751,567.04
ULTA BEAUTY INC	4,315	386.26	1,666,711.90
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	31.65	189,900.00
COSTCO WHOLESALE CORP	36,343	471.43	17,133,180.49
KROGER CO	56,126	42.94	2,410,050.44
SYSCO CORP	42,228	77.45	3,270,558.60

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	33.39	1,995,620.13
WALMART INC	124,048	133.76	16,592,660.48
ALTRIA GROUP INC	148,393	44.67	6,628,715.31
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	46,575	88.35	4,114,901.25
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	64.26	1,542,625.56
BUNGE LIMITED	11,604	90.60	1,051,322.40
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	50.98	809,001.62
COCA-COLA CO	337,769	55.96	18,901,553.24
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	44.97	692,268.18
CONAGRA BRANDS INC	40,304	34.93	1,407,818.72
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	223.26	2,888,984.40
GENERAL MILLS INC	49,534	78.13	3,870,091.42
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	226.26	2,719,418.94
HORMEL FOODS CORP	23,338	46.12	1,076,348.56
JM SMUCKER CO	9,145	143.04	1,308,100.80
KELLOGG CO	21,630	73.58	1,591,535.40
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	37.78	2,348,215.90
KRAFT HEINZ CO/THE	58,511	36.29	2,123,364.19
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	74.69	1,552,805.10
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	48.31	708,659.39
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	113,286	57.70	6,536,602.20
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	88.24	2,847,240.08
PEPSICO INC	113,421	173.36	19,662,664.56
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	126,117	86.47	10,905,336.99
TYSON FOODS INC	23,306	65.02	1,515,356.12
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	73.62	1,424,252.52
CLOROX COMPANY	9,570	136.87	1,309,845.90
COLGATE-PALMOLIVE CO	65,702	71.75	4,714,118.50
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,016	207.29	3,941,826.64
KIMBERLY-CLARK CORP	26,841	114.94	3,085,104.54
PROCTER & GAMBLE CO	196,677	129.56	25,481,472.12
ABBOTT LABORATORIES	143,383	98.11	14,067,306.13
ABIOMED INC	3,781	253.24	957,500.44
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	204.98	1,218,196.14
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	142.99	1,843,999.04
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	55.32	2,213,519.16
BECTON DICKINSON & CO	23,274	225.47	5,247,588.78
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,818	40.96	4,784,865.28
CARDINAL HEALTH	21,902	70.80	1,550,661.60
CENTENE CORP	48,335	75.72	3,659,926.20
CIGNA CORP	26,188	293.08	7,675,179.04
CVS HEALTH CORP	106,862	91.66	9,794,970.92

DAVITA INC	4,627	90.67	419,530.09
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	28.82	512,246.68
DEXCOM INC	32,658	96.84	3,162,600.72
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	51,357	85.95	4,414,134.15
ELEVANCE HEALTH INC	19,661	487.81	9,590,832.41
HCA HEALTHCARE INC	19,440	209.19	4,066,653.60
HENRY SCHEIN INC	11,747	67.68	795,036.96
HOLOGIC INC	19,018	62.17	1,182,349.06
HUMANA INC	10,365	500.21	5,184,676.65
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	335.49	2,264,892.99
INSULET CORP	5,311	215.82	1,146,220.02
INTUITIVE SURGICAL INC	29,197	211.14	6,164,654.58
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	208.82	1,585,987.90
MASIMO CORP	4,147	135.08	560,176.76
MCKESSON CORP	12,089	360.66	4,360,018.74
MEDTRONIC PLC	109,343	83.66	9,147,635.38
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	353.21	1,605,339.45
NOVOCURE LTD	7,933	71.11	564,115.63
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	126.66	1,267,233.30
RESMED INC	12,169	215.30	2,619,985.70
STERIS PLC	8,018	167.13	1,340,048.34
STRYKER CORP	28,067	216.69	6,081,838.23
TELADOC HEALTH INC	11,375	24.25	275,843.75
TELEFLEX INC	3,934	197.90	778,538.60
THE COOPER COS INC	4,134	256.48	1,060,288.32
UNITEDHEALTH GROUP INC	76,869	520.32	39,996,478.08
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	95.05	579,995.10
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	156.20	1,758,031.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	108.12	1,760,301.72
ABBVIE INC	144,953	143.13	20,747,122.89
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	128.96	3,067,313.60
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	192.00	1,851,456.00
AMGEN	43,905	248.19	10,896,781.95
AVANTOR INC	48,633	20.14	979,468.62
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	385.23	713,831.19
BIO-TECHNE CORP	3,245	290.02	941,114.90
BIOGEN INC	11,860	264.45	3,136,377.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	88.35	1,306,078.05
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	173,351	71.14	12,332,190.14
CATALENT INC	13,739	71.08	976,568.12
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	199.60	839,118.40
DANAHER CORP	56,691	257.89	14,620,041.99

ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	11.91	429,486.51
EXACT SCIENCES CORP	14,756	32.69	482,373.64
GILEAD SCIENCES INC	103,360	66.19	6,841,398.40
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	63.74	1,142,603.24
ILLUMINA INC	12,506	204.73	2,560,353.38
INCYTE CORP	15,212	69.59	1,058,603.08
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	178.39	2,698,327.14
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	132.33	657,812.43
JOHNSON & JOHNSON	215,641	164.69	35,513,916.29
LILLY (ELI) & CO	66,242	329.29	21,812,828.18
MERCK & CO	207,468	93.26	19,348,465.68
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,166.97	2,109,881.76
MODERNA INC	27,309	123.52	3,373,207.68
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	109.50	927,903.00
PERKINELMER INC	10,545	127.66	1,346,174.70
PFIZER	460,155	43.11	19,837,282.05
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,915	709.37	6,324,033.55
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	41.04	1,072,293.12
SEAGEN INC	10,981	129.83	1,425,663.23
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	8.07	743,577.87
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,118	505.61	16,239,181.98
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,811	292.02	6,077,228.22
VIATRIS INC	90,748	9.38	851,216.24
WATERS CORP	4,749	277.36	1,317,182.64
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	243.64	1,405,071.88
ZOETIS INC	38,534	148.13	5,708,041.42
BANK OF AMERICA CORP	591,261	33.92	20,055,573.12
CITIGROUP	158,792	43.34	6,882,045.28
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	36.72	1,451,247.84
FIFTH THIRD BANCORP	57,420	33.26	1,909,789.20
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	867.09	823,735.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,984	111.79	1,675,061.36
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	13.62	1,554,205.44
JPMORGAN CHASE & CO	240,076	116.51	27,971,254.76
KEY CORP	71,472	16.49	1,178,573.28
M & T BANK CORP	14,929	163.06	2,434,322.74
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,513	151.70	5,235,622.10
REGIONS FINL CORP	79,314	20.90	1,657,662.60
SIGNATURE BANK	4,686	152.29	713,630.94
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	315.37	1,433,356.65
TRUIST FINANCIAL CORP	109,883	42.44	4,663,434.52
US BANCORP	116,467	41.26	4,805,428.42

WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	48.55	692,954.15
WELLS FARGO & CO	310,526	43.62	13,545,144.12
ALLY FINANCIAL INC	27,761	26.43	733,723.23
AMERICAN EXPRESS	52,626	143.97	7,576,565.22
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	264.30	2,299,938.60
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	49.46	1,575,498.84
BANK NEW YORK CO	61,254	39.02	2,390,131.08
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,127	278.34	29,261,049.18
BLACKROCK INC	12,394	577.90	7,162,492.60
BLACKSTONE INC	57,841	87.74	5,074,969.34
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	95.23	3,166,968.88
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	25.90	405,827.10
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	119.75	1,062,781.25
CME GROUP INC	29,373	172.80	5,075,654.40
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	63.19	605,107.44
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	93.43	2,186,542.29
EQUITABLE HOLDINGS INC	34,355	28.14	966,749.70
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	406.10	1,278,402.80
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	22.25	580,057.50
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	34.07	147,046.12
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,241	311.76	8,804,414.16
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	91.63	4,096,135.89
INVESCO LTD	26,420	14.64	386,788.80
KKR & CO INC	44,282	45.77	2,026,787.14
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	237.06	1,513,865.16
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	233.47	748,738.29
MOODY'S CORP	13,365	241.88	3,232,726.20
MORGAN STANLEY	107,356	77.64	8,335,119.84
MSCI INC	6,518	398.79	2,599,313.22
NASDAQ INC	28,971	56.00	1,622,376.00
NORTHERN TRUST CORP	15,902	79.59	1,265,640.18
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	101.15	1,811,293.05
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	100.00	1,548,600.00
S&P GLOBAL INC	28,338	296.87	8,412,702.06
SCHWAB (CHARLES) CORP	118,155	68.71	8,118,430.05
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	48.44	462,602.00
STATE STREET CORP	30,359	64.57	1,960,280.63
SYNCHRONY FINANCIAL	41,566	31.59	1,313,069.94
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	53.35	483,404.35
AFLAC	50,591	60.14	3,042,542.74
ALLSTATE CORP	22,174	135.15	2,996,816.10
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	131.48	830,822.12

AMERICAN INT'L GROUP	65,898	52.75	3,476,119.50
AON PLC	17,038	280.93	4,786,485.34
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	48.72	1,448,250.72
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,431	178.05	3,103,589.55
ASSURANT INC	4,726	151.99	718,304.74
BROWN & BROWN INC	19,873	62.90	1,250,011.70
CHUBB LTD	34,810	195.98	6,822,063.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	101.04	1,292,402.64
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	238.77	517,175.82
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	279.68	919,587.84
FNF GROUP	20,461	36.90	755,010.90
GLOBE LIFE INC	8,106	112.56	912,411.36
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	68.00	1,885,028.00
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	48.47	653,569.48
LOEWS CORP	16,741	54.54	913,054.14
MARKEL CORP	1,156	1,161.78	1,343,017.68
MARSH & MCLENNAN COS	41,045	156.97	6,442,833.65
METLIFE INC	57,127	67.34	3,846,932.18
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	78.77	1,632,035.63
PROGRESSIVE CORP	48,534	121.20	5,882,320.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,146	96.42	3,003,097.32
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	174.17	3,443,689.24
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,385	208.56	1,957,335.60
WR BERKLEY CORP	17,572	71.46	1,255,695.12
CBRE GROUP INC-A	27,714	67.83	1,879,840.62
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.29	423,423.00
WEYERHAEUSER CO	64,295	29.05	1,867,769.75
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	28.72	385,623.44
ACCENTURE PLC-CL A	51,987	264.06	13,727,687.22
ADOBE INC	38,782	299.83	11,628,007.06
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	17.91	229,534.56
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	82.94	1,134,038.62
ANSYS INC	6,794	214.19	1,455,206.86
APPLOVIN CORP-CLASS A	10,000	17.44	174,400.00
AUTODESK INC	17,467	197.02	3,441,348.34
AUTOMATIC DATA PROCESS	34,246	233.24	7,987,537.04
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	33.31	466,206.76
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	126.34	940,348.62
BLACK KNIGHT INC	11,543	60.68	700,429.24
BLOCK INC	41,288	53.94	2,227,074.72
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	143.50	1,397,977.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	22,740	153.72	3,495,592.80

CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	56.84	606,369.12
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	111.85	908,669.40
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	51.63	1,047,211.29
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	43,220	59.81	2,584,988.20
COUPA SOFTWARE INC	6,059	52.37	317,309.83
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,831	152.54	2,567,400.74
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	149.04	462,024.00
DATADOG INC - CLASS A	20,137	79.00	1,590,823.00
DOCUSIGN INC	14,969	46.55	696,806.95
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	20.90	482,121.20
DYNATRACE INC	14,790	33.65	497,683.50
EPAM SYSTEMS INC	4,779	331.65	1,584,955.35
FAIR ISAAC CORP	2,125	408.95	869,018.75
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	49,912	76.73	3,829,747.76
FISERV INC	49,921	96.23	4,803,897.83
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	167.48	1,005,214.96
FORTINET INC	56,318	51.79	2,916,709.22
GARTNER INC	6,340	286.27	1,814,951.80
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	112.67	2,542,623.89
GODADDY INC - CLASS A	13,798	75.18	1,037,333.64
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	55.77	352,354.86
HUBSPOT INC	3,646	263.57	960,976.22
INTL BUSINESS MACHINES CORP	73,262	122.51	8,975,327.62
INTUIT INC	21,909	402.07	8,808,951.63
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	187.11	1,177,109.01
MASTERCARD INC-CLASS A	70,879	297.76	21,104,931.04
MICROSOFT CORP	581,193	236.48	137,440,520.64
MONGODB INC	5,325	184.77	983,900.25
NORTONLIFELOCK INC	43,549	21.51	936,738.99
OKTA INC	11,505	53.83	619,314.15
ORACLE CORP	130,499	66.30	8,652,083.70
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	7.91	990,680.04
PALO ALTO NETWORKS INC	24,237	160.11	3,880,586.07
PAYCHEX INC	26,693	111.45	2,974,934.85
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	320.50	1,357,317.50
PAYPAL HOLDINGS INC	90,208	84.47	7,619,869.76
PTC INC	9,804	108.62	1,064,910.48
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	31.77	203,105.61
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,672	371.43	3,221,040.96
SALESFORCE INC	81,603	153.67	12,539,933.01
SERVICENOW INC	16,309	355.44	5,796,870.96
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,680	171.04	3,023,987.20

SPLUNK INC	13,355	77.08	1,029,403.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	48.41	936,007.35
SYNOPSYS INC	12,539	288.96	3,623,269.44
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	55.23	2,025,339.33
TWILIO INC - A	12,842	68.76	883,015.92
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	336.37	1,123,139.43
UNITY SOFTWARE INC	16,329	29.48	481,378.92
VERISIGN INC	7,790	182.10	1,418,559.00
VISA INC-CLASS A SHARES	134,653	186.41	25,100,665.73
VMWARE INC-CLASS A	16,717	107.73	1,800,922.41
WESTERN UNION CO	29,297	14.25	417,482.25
WIX.COM LTD	5,010	72.71	364,277.10
WORKDAY INC-CLASS A	16,567	146.50	2,427,065.50
ZENDESK INC	8,890	76.73	682,129.70
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19,002	76.33	1,450,422.66
ZSCALER INC	7,204	148.77	1,071,739.08
AMPHENOL CORPORATION	47,707	70.09	3,343,783.63
APPLE INC	1,323,830	143.86	190,446,183.80
ARISTA NETWORKS INC	20,350	105.11	2,138,988.50
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	95.80	584,380.00
CDW CORP/DE	10,882	159.47	1,735,352.54
CISCO SYSTEMS	337,789	41.88	14,146,603.32
COGNEX CORP	14,352	43.45	623,594.40
CORNING	64,989	31.42	2,041,954.38
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	34.49	775,369.69
F5 INC	4,851	142.40	690,782.40
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,530	12.82	1,404,174.60
HP INC	83,910	25.49	2,138,865.90
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	27.37	693,035.77
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	161.15	2,415,477.35
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,836	223.85	3,097,188.60
NETAPP INC	18,303	62.29	1,140,093.87
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	52.85	876,411.55
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	112.03	2,920,398.04
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	348.51	1,358,840.49
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	54.83	1,161,080.08
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	33.36	860,354.40
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	260.46	1,084,034.52
AT&T INC	581,626	15.54	9,038,468.04
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	16.57	257,100.12
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	17.45	479,648.15
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	6.85	505,317.65

T-MOBILE US INC	50,968	135.74	6,918,396.32
VERIZON COMMUNICATIONS	344,746	36.57	12,607,361.22
AES CORP	54,375	24.13	1,312,068.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	50.35	1,046,172.30
AMEREN CORPORATION	20,898	78.56	1,641,746.88
AMERICAN ELECTRIC POWER	42,467	85.90	3,647,915.30
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,165	134.00	2,032,110.00
ATMOS ENERGY CORP	10,802	102.04	1,102,236.08
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	27.00	1,300,374.00
CMS ENERGY CORP	23,697	55.63	1,318,264.11
CONSOLIDATED EDISON INC	29,197	84.54	2,468,314.38
CONSTELLATION ENERGY	25,732	85.69	2,204,975.08
DOMINION ENERGY INC	66,909	65.69	4,395,252.21
DTE ENERGY COMPANY	15,851	108.63	1,721,894.13
DUKE ENERGY CORP	62,802	89.29	5,607,590.58
EDISON INTL	30,339	56.74	1,721,434.86
ENTERGY CORP	16,181	101.74	1,646,254.94
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	41.34	843,294.66
EVERGY INC	18,475	58.32	1,077,462.00
EVERSOURCE ENERGY	28,450	74.50	2,119,525.00
EXELON CORP	81,218	36.85	2,992,883.30
FIRSTENERGY CORP	45,165	36.92	1,667,491.80
NEXTERA ENERGY INC	159,643	73.64	11,756,110.52
NISOURCE INC	32,351	24.88	804,892.88
NRG ENERGY INC	19,068	41.96	800,093.28
PG&E CORP	118,132	13.96	1,649,122.72
PPL CORPORATION	58,459	25.33	1,480,766.47
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	54.80	2,162,846.40
SEMPRA ENERGY	25,885	143.74	3,720,709.90
SOUTHERN CO	86,558	64.69	5,599,437.02
UGI CORP	18,019	32.60	587,419.40
VISTRA CORP	31,797	22.20	705,893.40
WEC ENERGY GROUP INC	26,033	86.77	2,258,883.41
XCEL ENERGY INC	43,741	61.10	2,672,575.10
ADVANCED MICRO DEVICES	132,978	57.23	7,610,330.94
ANALOG DEVICES	42,691	141.33	6,033,519.03
APPLIED MATERIALS	72,040	77.26	5,565,810.40
BROADCOM INC	32,989	435.30	14,360,111.70
ENPHASE ENERGY INC	11,020	243.19	2,679,953.80
ENTEGRIS INC	12,483	76.50	954,949.50
INTEL CORP	336,001	26.00	8,736,026.00
KLA CORP	12,119	271.96	3,295,883.24

	LAM RESEARCH CORP	11,398	330.08	3,762,251.84	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,444	38.10	2,683,916.40	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	59.32	2,627,223.48	
	MICRON TECHNOLOGY	91,511	53.03	4,852,828.33	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	314.83	1,111,664.73	
	NVIDIA CORP	205,210	120.51	24,729,857.10	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	21,751	141.32	3,073,851.32	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	60.77	2,094,620.36	
	QORVO INC	8,556	81.78	699,709.68	
	QUALCOMM	91,671	112.85	10,345,072.35	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	81.69	1,092,358.68	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,864	199.46	970,173.44	
	TERADYNE INC	12,318	73.18	901,431.24	
	TEXAS INSTRUMENTS	75,121	152.65	11,467,220.65	
	アメリカドル 小計	27,872,029		2,621,095,979.98	(393,111,975,077)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	18.10	992,966.00	
	CAMECO CORP	31,793	31.41	998,618.13	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,374	76.22	7,345,626.28	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	24.43	2,718,887.99	
	ENBRIDGE	165,402	51.35	8,493,392.70	
	IMPERIAL OIL	20,285	67.06	1,360,312.10	
	KEYERA CORP	18,607	28.56	531,415.92	
	PARKLAND CORP	14,075	27.45	386,358.75	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	43.94	2,006,564.04	
	SUNCOR ENERGY	116,208	43.50	5,055,048.00	
	TC ENERGY CORP	81,350	58.45	4,754,907.50	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	75.00	1,875,675.00	
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	55.62	2,022,009.48	
	BARRICK GOLD CORP	139,009	19.91	2,767,669.19	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	65.56	861,392.84	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	23.00	989,000.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	161.67	2,483,736.21	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	8.63	447,439.61	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	4.59	497,790.09	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	6.63	412,671.09	
	NUTRIEN LTD	44,786	112.44	5,035,737.84	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	21.09	388,287.99	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	40,179	45.03	1,809,260.37	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	98.69	602,009.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	42.79	1,465,044.02	
	CAE INC	25,999	23.63	614,356.37	

TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	99.46	754,404.10
WSP GLOBAL INC	9,951	153.50	1,527,478.50
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	35.25	476,051.25
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	87.45	895,925.25
THOMSON REUTERS CORP	13,293	140.29	1,864,874.97
AIR CANADA	13,805	18.05	249,180.25
CANADIAN NATL RAILWAY CO	48,612	155.52	7,560,138.24
CP RAILWAY LIMITED	75,991	97.56	7,413,681.96
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	131.45	767,273.65
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	70.04	1,630,671.28
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	83.84	257,388.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	42.75	730,127.25
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	76.79	1,771,775.67
QUEBECOR INC -CL B	15,200	24.48	372,096.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	33.75	1,195,492.50
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	150.17	677,717.21
DOLLARAMA INC	22,000	80.22	1,764,840.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	57.07	3,850,341.69
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	34.03	519,059.59
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	109.04	1,408,033.52
METRO INC	18,840	69.34	1,306,365.60
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	144.89	757,195.14
SAPUTO INC	20,898	31.65	661,421.70
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	8.73	181,584.00
BANK MONTREAL	55,487	120.92	6,709,488.04
BANK NOVA SCOTIA	99,336	64.89	6,445,913.04
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,829	59.07	4,242,939.03
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	88.28	2,409,072.92
ROYAL BANK OF CANADA	115,288	123.28	14,212,704.64
TORONTO-DOMINION BANK	148,462	85.71	12,724,678.02
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	116,005	53.37	6,191,186.85
IGM FINANCIAL INC	7,685	36.15	277,812.75
ONEX CORP	6,603	66.51	439,165.53
TMX GROUP LTD	4,685	129.33	605,911.05
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	622.35	1,327,472.55
GREAT-WEST LIFE CO INC	23,788	29.77	708,168.76
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	73.74	744,700.26
INTACT FINANCIAL CORP	15,012	195.83	2,939,799.96
MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	21.93	3,394,281.54
POWER CORP OF CANADA	43,577	32.25	1,405,358.25
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	56.25	2,570,737.50
FIRSTSERVICE CORP	2,690	163.23	439,088.70

	BLACKBERRY LIMITED	39,400	5.84	230,096.00
	CGI INC - CL A	18,300	105.07	1,922,781.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	1,840.06	2,951,456.24
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	23.85	197,859.60
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	36.01	154,879.01
	OPEN TEXT CORP	20,463	37.46	766,543.98
	SHOPIFY INC - CLASS A	92,560	39.04	3,613,542.40
	BCE INC	6,203	59.13	366,783.39
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,196	52.87	1,596,462.52
	TELUS CORP	32,908	27.90	918,133.20
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	14.55	753,951.90
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	25.39	619,389.05
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	42.37	478,569.15
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.59	357,107.16
	EMERA INC	23,223	51.68	1,200,164.64
	FORTIS INC	40,183	51.37	2,064,200.71
	HYDRO ONE LTD	28,888	31.53	910,838.64
	NORTHLAND POWER INC	17,854	38.13	680,773.02
	カナダドル 小計	3,336,560		183,081,305.63 (19,937,554,183)
ユーロ	ENI	212,616	11.86	2,522,901.45
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	9.69	384,483.42
	NESTE OIL OYJ	36,735	44.89	1,649,034.15
	OMV AG	12,549	40.11	503,340.39
	REPSOL SA	111,112	12.93	1,436,678.16
	TENARIS SA	40,648	14.70	597,728.84
	TOTALENERGIES SE	203,322	52.61	10,696,770.42
	AIR LIQUIDE	43,239	120.96	5,230,189.44
	AKZO NOBEL	15,301	61.66	943,459.66
	ARCELORMITTAL	48,641	22.08	1,073,993.28
	ARKEMA	4,369	77.68	339,383.92
	BASF SE	73,837	45.05	3,326,356.85
	COVESTRO AG	14,454	35.25	509,503.50
	CRH PLC	65,449	34.37	2,249,482.13
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	18.51	296,925.05
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	43.86	571,978.26
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	120.10	1,646,210.70
	OCI NV	12,000	41.38	496,560.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	32.24	628,808.96
	SOLVAY SA	5,356	88.38	473,363.28
	STORA ENSO OYJ R	42,169	13.93	587,414.17
	SYMRISE AG	11,830	98.64	1,166,911.20

UMICORE	17,605	31.93	562,127.65
UPM KYMMENE OYJ	42,324	34.64	1,466,103.36
VOESTALPINE AG	7,152	20.14	144,041.28
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	22,552	23.84	537,639.68
AIRBUS SE	49,560	100.88	4,999,612.80
ALSTOM	24,388	19.15	467,030.20
BOUYGUES ORD	16,606	27.37	454,506.22
BRENTAG SE	12,514	58.82	736,073.48
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.60	1,020,927.60
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	26.03	869,256.58
DASSAULT AVIATION SA	2,130	141.70	301,821.00
EIFFAGE	5,924	84.46	500,341.04
FERROVIAL SA	43,631	23.98	1,046,271.38
GEA GROUP AG	13,382	34.32	459,270.24
IMCD NV	4,641	120.90	561,096.90
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	49.83	617,792.34
KION GROUP AG	5,887	22.28	131,162.36
KNORR-BREMSE AG	5,022	45.42	228,099.24
KONE OYJ-B	26,311	40.30	1,060,333.30
LEGRAND SA	21,768	72.84	1,585,581.12
MTU AERO ENGINES AG	3,962	173.55	687,605.10
PRYSMIAN SPA	21,155	31.99	676,748.45
RATIONAL AG	483	552.00	266,616.00
RHEINMETALL AG	3,660	150.35	550,281.00
SAFRAN SA	28,774	106.04	3,051,194.96
SAINT-GOBAIN	40,093	39.44	1,581,267.92
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,670	125.46	5,604,298.20
SIEMENS	63,788	107.98	6,887,828.24
SIEMENS ENERGY AG	36,841	11.31	416,671.71
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	17.92	402,035.20
THALES SA	8,524	116.00	988,784.00
VINCI S.A.	44,993	86.55	3,894,144.15
WARTSILA OYJ	41,917	7.32	307,167.77
BUREAU VERITAS SA	25,073	23.98	601,250.54
RANDSTAD NV	10,558	46.39	489,785.62
TELEPERFORMANCE	4,734	264.10	1,250,249.40
WOLTERS KLUWER	20,839	101.30	2,110,990.70
ADP	2,382	127.80	304,419.60
AENA SME SA	5,508	107.55	592,385.40
ATLANTIA SPA	43,726	22.51	984,272.26
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.75	306,382.65
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	34.34	2,703,432.33

GETLINK	35,220	15.73	554,186.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	77.66	2,027,469.62
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	72.95	364,093.45
CONTINENTAL AG	8,168	49.77	406,521.36
DR ING HC F PORSCHE AG	9,400	93.36	877,584.00
FERRARI NV	10,170	191.85	1,951,114.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	64,434	57.47	3,703,021.98
MICHELIN	55,356	23.30	1,289,794.80
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	57.78	678,626.10
RENAULT SA	17,362	32.03	556,191.67
STELLANTIS NV	175,794	12.96	2,279,696.59
VALEO SA	16,596	16.95	281,302.20
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,874	129.86	2,061,397.64
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	168.80	419,636.80
ADIDAS AG	13,972	115.68	1,616,280.96
ESSILORLUXOTTICA	22,910	157.15	3,600,306.50
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,305.00	3,313,395.00
KERING	6,271	459.00	2,878,389.00
LVMH	22,668	625.00	14,167,500.00
MONCLER SPA	19,057	46.33	882,910.81
PUMA SE	9,220	46.81	431,588.20
SEB SA	2,282	62.25	142,054.50
ACCOR	14,436	22.50	324,810.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	121.05	1,579,460.40
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	31.58	256,050.64
SODEXO	6,027	84.82	511,210.14
BOLLORE SE	83,646	4.84	405,181.22
PUBLICIS GROUPE	17,077	56.98	973,047.46
SCOUT24 SE	7,492	53.78	402,919.76
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	26.58	187,947.18
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	18.93	1,159,452.47
VIVENDI SE	61,243	8.13	498,150.56
D' IETEREN GROUP	2,217	157.80	349,842.60
DELIVERY HERO SE	13,414	35.71	479,013.94
INDITEX	87,326	22.73	1,984,919.98
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	15.50	241,490.57
PROSUS	66,706	50.71	3,382,661.26
ZALANDO SE	17,664	23.06	407,331.84
CARREFOUR	52,544	15.25	801,558.72
HELLOFRESH SE	13,805	21.58	297,911.90
JERONIMO MARTINS	24,901	19.77	492,292.77
KESKO OYJ-B SHS	20,083	18.82	377,962.06

KONINKLIJKE AHOLD NV	86,170	27.66	2,383,893.05
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,659	46.66	3,390,268.94
DANONE (GROUPE)	51,543	48.09	2,478,702.87
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	8.80	432,172.06
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	70.00	647,570.00
HEINEKEN NV	20,157	87.64	1,766,559.48
JDE PEET'S BV	7,000	29.56	206,920.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	88.96	1,160,928.00
PERNOD-RICARD	16,694	180.00	3,004,920.00
REMY COINTREAU	1,382	163.00	225,266.00
BEIERSDORF AG	7,430	99.70	740,771.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	59.45	521,971.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	63.28	913,699.92
LOREAL	19,843	327.60	6,500,566.80
AMPLIFON SPA	11,650	25.64	298,706.00
BIOMERIEUX	3,044	85.38	259,896.72
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	113.25	388,447.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	126.00	260,820.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	28.12	477,618.20
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	21.63	728,693.07
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	13.48	967,544.42
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	44.84	967,064.28
ARGENX SE	4,713	374.10	1,763,133.30
BAYER	78,757	49.75	3,918,160.75
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	61.50	628,530.00
GRIFOLS SA	27,685	8.38	232,000.30
IPSEN	3,532	103.10	364,149.20
MERCK KGAA	10,555	163.85	1,729,436.75
ORION OYJ-CLASS B	9,854	43.29	426,579.66
QIAGEN N.V.	17,038	43.65	743,708.70
RECORDATI SPA	9,859	35.95	354,431.05
SANOFI	93,369	80.93	7,556,353.17
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	315.70	575,836.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,539	290.00	736,310.00
UCB (GROUPE)	9,389	74.32	697,790.48
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	9.55	381,245.55
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	4.96	2,655,609.69
BANCO SANTANDER SA	1,393,640	2.63	3,671,544.58
BNP PARIBAS	92,730	45.91	4,257,697.95
CAIXABANK	330,447	3.40	1,125,172.03
COMMERZBANK AG	81,889	7.89	646,104.21
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	8.84	879,263.97

ERSTE GROUP BANK AG	31,905	24.61	785,182.05
FINECOBANK SPA	53,120	12.69	674,092.80
ING GROEP NV-CVA	324,888	9.53	3,099,106.63
INTESA SANPAOLO	1,322,943	1.79	2,370,184.67
KBC GROEP NV	18,608	49.08	913,280.64
MEDIOBANCA	53,990	8.41	454,379.84
SOCIETE GENERALE	63,329	22.53	1,427,119.01
UNICREDIT SPA	168,352	11.20	1,886,215.80
AMUNDI SA	4,626	44.38	205,301.88
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	8.88	1,427,367.73
DEUTSCHE BOERSE	14,999	163.30	2,449,336.70
EURAZEO SA	3,357	54.75	183,795.75
EURONEXT NV	6,480	62.66	406,036.80
EXOR NV	7,825	68.14	533,195.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	73.10	622,446.50
SOFINA	1,238	187.50	232,125.00
WENDEL	2,023	77.10	155,973.30
AEGON	148,741	4.22	628,728.20
AGEAS	11,086	40.11	444,659.46
ALLIANZ SE-REG	34,133	172.38	5,883,846.54
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	14.65	1,255,010.23
AXA SA	154,335	24.49	3,780,435.82
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	156.05	676,164.65
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,889	251.60	2,991,272.40
NN GROUP NV	22,611	41.75	944,009.25
POSTE ITALIANE SPA	46,035	8.35	384,392.25
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	45.44	1,756,483.20
AROUNDTOWN SA	64,068	1.90	121,761.23
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	59.88	315,867.00
VONOVIA SE	59,080	20.68	1,221,774.40
ADYEN NV	1,746	1,326.00	2,315,196.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	49.81	1,772,439.04
BECHTLE AG	7,659	33.56	257,036.04
CAPGEMINI SA	13,877	162.90	2,260,563.30
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	34.26	1,807,797.42
EDENRED	22,564	48.74	1,099,769.36
NEMETSCHKE SE	5,455	47.84	260,967.20
NEXI SPA	48,458	8.85	429,047.13
SAP SE	85,927	89.16	7,661,251.32
WORLDLINE SA	20,332	43.70	888,508.40
NOKIA OYJ	427,600	4.74	2,029,817.20
CELLNEX TELECOM SA	46,824	29.52	1,382,244.48

	DEUTSCHE TELEKOM	271,698	18.23	4,953,054.54	
	ELISA A	10,227	48.00	490,896.00	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	8.43	256,122.00	
	KPN (KON.)	282,927	2.78	787,102.91	
	ORANGE	153,815	9.52	1,465,241.69	
	PROXIMUS	13,141	9.58	125,917.06	
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.18	160,961.81	
	TELEFONICA	431,420	3.39	1,465,102.32	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.11	208,584.79	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	19.08	181,555.60	
	ACCIONA SA	2,181	167.40	365,099.40	
	E.ON SE	195,549	8.05	1,574,560.54	
	EDP RENOVAVEIS SA	21,466	20.13	432,110.58	
	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.93	471,485.53	
	ELIA GROUP SA/NV	3,125	119.10	372,187.50	
	ENAGAS	21,663	15.20	329,277.60	
	ENDESA	25,972	15.04	390,748.74	
	ENEL	650,125	4.28	2,784,810.43	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.25	960,804.76	
	ENGIE	158,924	12.25	1,948,090.39	
	FORTUM OYJ	32,550	13.90	452,607.75	
	IBERDROLA SA	477,647	9.55	4,563,439.43	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	24.02	240,440.20	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	15.31	469,680.18	
	RWE STAMM	55,432	37.96	2,104,198.72	
	SNAM SPA	147,559	4.22	623,731.89	
	TERNA SPA	102,810	6.20	638,244.48	
	UNIPER SE	7,335	3.82	28,034.37	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	21.43	1,093,508.61	
	VERBUND AG	6,430	80.10	515,043.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,995	244.45	976,577.75	
	ASML HOLDING NV	33,358	436.50	14,560,767.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES	110,035	24.77	2,725,566.95	
	STMICROELECTRONICS	55,076	32.80	1,806,768.18	
	ユーロ 小計	14,966,235		322,317,216.32 (47,206,579,502)	
イギリスポンド	BP PLC	1,596,790	4.55	7,269,386.47	
	SHELL PLC-NEW	608,239	22.73	13,825,272.47	
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	26.30	2,686,702.80	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	10.85	389,216.88	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	64.96	709,623.04	
	GLENCORE PLC	817,868	4.73	3,868,515.64	

JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	18.87	317,921.76
MONDI PLC	36,710	14.41	529,174.65
RIO TINTO PLC REG	94,110	47.33	4,454,226.30
ASHTED GROUP PLC	37,687	43.26	1,630,339.62
BAE SYSTEMS PLC	260,104	8.09	2,105,801.98
BUNZL PLC	24,880	27.78	691,166.40
DCC PLC	6,622	48.05	318,187.10
FERGUSON PLC	17,761	92.88	1,649,641.68
MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.03	331,608.74
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.74	470,572.66
SMITHS GROUP PLC	26,476	15.33	406,009.46
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	106.00	584,484.00
EXPERIAN PLC	74,115	26.76	1,983,317.40
INTERTEK GROUP PLC	13,890	37.24	517,263.60
RELX PLC	154,242	22.23	3,428,799.66
RENTOKIL INITIAL PLC	212,480	5.07	1,078,123.52
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	3.44	251,961.28
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	33.73	259,316.24
BURBERRY GROUP PLC	29,776	18.60	553,833.60
PERSIMMON PLC	25,686	12.33	316,708.38
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	0.88	234,365.88
COMPASS GROUP PLC	142,427	18.12	2,580,777.24
ENTAIN PLC	49,630	11.54	572,730.20
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	45.56	674,789.16
WHITBREAD PLC	17,434	25.48	444,218.32
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.17	375,208.23
INFORMA PLC	110,598	5.56	615,588.46
PEARSON	55,305	8.89	492,103.89
WPP PLC	95,821	7.49	717,890.93
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	0.98	203,557.16
KINGFISHER PLC	153,717	2.03	312,045.51
NEXT PLC	11,468	47.59	545,762.12
OCADO GROUP PLC	54,753	4.78	261,719.34
SAINSBURY (J) PLC	148,335	1.82	271,378.88
TESCO PLC	601,050	2.05	1,232,152.50
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	13.22	340,282.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	178,799	33.03	5,906,624.96
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	19.59	351,926.20
DIAGEO	189,615	36.61	6,942,753.22
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	20.26	1,541,380.80
HALEON PLC	405,046	2.66	1,081,270.29
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,052	59.12	3,550,274.24

	UNILEVER PLC	209,465	38.99	8,168,087.67
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.00	686,292.97
	ASTRAZENECA	126,291	98.09	12,387,884.19
	GSK PLC	334,172	13.82	4,618,925.38
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	12.33	202,877.82
	BARCLAYS	1,339,545	1.44	1,932,963.43
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,655,458	4.74	7,846,870.92
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,667,831	0.40	2,301,706.16
	NATWEST GROUP PLC	412,008	2.31	952,150.48
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.60	1,190,122.49
	3I GROUP PLC	74,757	10.97	820,458.07
	ABRDN PLC	153,430	1.44	221,629.63
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.65	253,120.50
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	74.60	1,961,756.20
	M&G PLC	229,107	1.76	403,457.42
	SCHRODERS PLC	69,376	3.78	262,449.40
	ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	9.93	406,720.22
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	19.48	316,728.67
	AVIVA PLC	225,378	4.08	920,218.37
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.28	1,050,530.52
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.38	274,589.38
	PRUDENTIAL	230,270	8.93	2,056,311.10
	AVEVA GROUP PLC	10,917	31.50	343,885.50
	SAGE GROUP PLC	76,660	7.01	537,693.24
	HALMA PLC	31,069	20.44	635,050.36
	BT GROUP PLC	557,358	1.27	711,746.16
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.01	2,230,321.05
	NATIONAL GRID PLC	302,035	9.04	2,731,604.54
	SEVERN TRENT PLC	22,468	23.45	526,874.60
	SSE PLC	90,604	14.78	1,339,127.12
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	8.98	526,517.04
	イギリスポンド 小計	23,204,687		138,694,646.26 (23,302,087,518)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	16.66	289,850.68
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	649.00	372,526.00
	GIVAUDAN-REG	748	2,920.00	2,184,160.00
	HOLCIM LTD	44,847	42.40	1,901,512.80
	SIG GROUP AG	26,203	19.81	519,081.43
	SIKA AG-BR	11,714	219.90	2,575,908.60
	ABB LTD	137,175	26.76	3,670,803.00
	GEBERIT AG-REG	2,964	436.30	1,293,193.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	156.00	319,488.00

SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	160.55	496,420.60		
VAT GROUP AG	1,956	210.20	411,151.20		
ADECCO GROUP AG-REG	10,450	29.59	309,215.50		
SGS SA	506	2,129.00	1,077,274.00		
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	207.50	949,727.50		
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,318	100.00	4,331,800.00		
SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	232.50	577,297.50		
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	43.24	170,279.12		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,854.00	519,120.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	98,100.00	784,800.00		
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,590.00	786,380.00		
NESTLE SA - REGISTERED	230,976	106.40	24,575,846.40		
ALCON INC	42,458	58.84	2,498,228.72		
SONOVA HOLDING AG-REG	4,686	228.90	1,072,625.40		
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	95.40	814,716.00		
BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	72.50	134,125.00		
LONZA GROUP AG-REG	6,283	490.60	3,082,439.80		
NOVARTIS	177,027	76.78	13,592,133.06		
ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	392.00	868,280.00		
ROCHE HOLDING GENUSS	57,316	326.00	18,685,016.00		
CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	4.62	986,924.71		
JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	44.87	847,908.39		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	825.40	1,512,958.20		
UBS GROUP AG	281,888	14.86	4,190,265.12		
BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	133.10	422,459.40		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	462.90	1,119,755.10		
SWISS RE LTD	24,445	74.40	1,818,708.00		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,554	416.60	5,229,996.40		
SWISS PRIME SITE-REG	5,679	79.15	449,492.85		
TEMENOS AG - REG	5,150	53.62	276,143.00		
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	43.95	645,449.70		
SWISSCOM	2,187	456.40	998,146.80		
スイスフラン 小計	1,431,967		107,361,607.18 (16,014,057,326)		
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	359.50	7,999,594.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	10,000	436.40	4,364,000.00	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	144.90	6,359,226.30	
	ALFA LAVAL AB	27,268	280.60	7,651,400.80	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	214.20	16,741,443.60	
	ATLAS COPCO A	227,097	108.70	24,685,443.90	
	ATLAS COPCO B	127,608	98.27	12,540,038.16	
	EPIROC AB-A	53,479	168.00	8,984,472.00	

	EPIROC AB-B	28,804	145.60	4,193,862.40
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	63.76	2,468,277.12
	INDUTRADE AB	22,644	179.90	4,073,655.60
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	178.30	2,496,556.60
	LIFCO AB-B SHS	17,970	152.30	2,736,831.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	86.32	10,604,239.36
	SANDVIK AB	87,644	165.80	14,531,375.20
	SKANSKA B	25,507	145.55	3,712,543.85
	SKF AB-B	37,718	167.00	6,298,906.00
	VOLVO AB-A SHS	13,514	183.10	2,474,413.40
	VOLVO B	121,238	175.96	21,333,038.48
	SECURITAS B	29,533	85.40	2,522,118.20
	VOLVO CAR AB-B	49,839	45.00	2,243,004.19
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	122.66	2,608,855.54
	EVOLUTION AB	14,096	924.00	13,024,704.00
	EMBRACER GROUP AB	53,147	55.40	2,944,343.80
	HENNES & MAURITZ B	55,229	113.80	6,285,060.20
	SWEDISH MATCH AB	127,270	110.30	14,037,881.00
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	222.30	10,998,070.20
	GETINGE AB-B SHS	17,796	201.80	3,591,232.80
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	209.40	3,001,749.00
	NORDEA BANK ABP	279,221	103.50	28,899,373.50
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	116.85	15,335,978.25
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	103.25	11,433,492.00
	SWEDBANK AB-A	72,526	159.15	11,542,512.90
	EQT AB	23,207	198.40	4,604,268.80
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	235.30	2,780,775.40
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	234.00	2,613,312.00
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	178.30	6,940,327.50
	INVESTOR AB-B SHS	156,321	171.20	26,762,155.20
	KINNEVIK AB - B	18,792	133.00	2,499,336.00
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	413.20	3,008,096.00
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	39.67	2,249,289.00
	SAGAX AB-B	12,402	180.35	2,236,700.70
	ERICSSON (LM) B	255,508	72.19	18,445,122.52
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	105.85	16,283,752.30
	TELE2 AB-B SHS	46,762	89.24	4,173,040.88
	TELIA CO AB	230,643	32.46	7,486,671.78
	スウェーデンクローナ 小計	3,169,430		392,800,541.43 (5,239,959,222)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	27,755	306.40	8,504,132.00
	EQUINOR ASA	81,436	359.10	29,243,667.60

	NORSK HYDRO	96,800	60.20	5,827,360.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	426.60	5,331,646.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	357.40	3,089,723.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	73.80	1,410,834.60	
	MOWI ASA	31,968	137.95	4,409,985.60	
	ORKLA	69,804	78.14	5,454,484.56	
	SALMAR ASA	5,423	324.00	1,757,052.00	
	DNB BANK ASA	71,795	186.00	13,353,870.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	195.00	3,621,930.00	
	TELENOR ASA	51,193	93.00	4,760,949.00	
	ノルウェークローネ 小計	495,008		86,765,635.16 (1,223,395,455)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	425.00	3,605,275.00	
	NOVOZYMES A/S	17,111	373.90	6,397,802.90	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,357.50	1,024,912.50	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	81,654	144.38	11,789,204.52	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	14,530.00	3,182,070.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	15,215.00	6,603,310.00	
	DSV A/S	15,307	946.80	14,492,667.60	
	PANDORA A/S	8,163	389.70	3,181,121.10	
	CARLSBERG AS-B	8,481	913.80	7,749,937.80	
	COLOPLAST-B	9,208	801.00	7,375,608.00	
	DEMANT A/S	8,512	200.70	1,708,358.40	
	GN STORE NORD A/S	9,226	149.80	1,382,054.80	
	GENMAB A/S	5,250	2,801.00	14,705,250.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	135,410	799.20	108,219,672.00	
	DANSKE BANK A/S	56,132	101.05	5,672,138.60	
TRYG A/S	29,772	157.45	4,687,601.40		
ORSTED A/S	15,439	594.50	9,178,485.50		
	デンマーククローネ 小計	409,556		210,955,470.12 (4,153,713,206)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	30.69	633,104.01	
	SANTOS	265,406	7.38	1,958,696.28	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	27.35	350,435.55	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	158,086	32.55	5,145,699.30	
	BHP GROUP LTD	414,748	39.25	16,278,859.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	16.40	570,228.00	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	2.01	245,529.54	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	17.21	2,385,168.32	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	33.16	1,225,195.68	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	72.29	1,041,626.61	
	NEWCREST MINING LIMITED	73,939	17.40	1,286,538.60	

NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	8.03	816,072.84
ORICA LTD	38,288	13.73	525,694.24
RIO TINTO LTD	28,818	94.01	2,709,180.18
SOUTH32 LTD	407,531	3.77	1,536,391.87
REECE LTD	16,814	14.94	251,201.16
BRAMBLES LTD	108,007	11.54	1,246,400.78
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.58	428,135.78
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.00	510,000.00
TRANSURBAN GROUP	249,674	12.68	3,165,866.32
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	35.74	1,651,545.40
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	60.74	215,080.34
IDP EDUCATION LTD	17,793	29.28	520,979.04
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.14	753,533.82
REA GROUP LTD	3,586	119.85	429,782.10
SEEK LTD	28,001	21.12	591,381.12
WESFARMERS LTD	91,917	44.68	4,106,851.56
COLES GROUP LTD	108,486	16.55	1,795,443.30
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.29	801,178.29
WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	33.45	3,341,688.45
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	13.05	834,678.00
COCHLEAR LIMITED	4,783	201.34	963,009.22
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	58.31	947,420.88
SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	31.05	1,156,643.55
CSL LIMITED	39,814	276.96	11,026,885.44
AUST AND NZ BANKING GROUP	247,511	25.83	6,393,209.13
COMMONWEALTH BANK OF AUST	139,969	100.48	14,064,085.12
NATIONAL AUSTRALIA BANK	267,570	31.66	8,471,266.20
WESTPAC BANKING	283,793	23.65	6,711,704.45
ASX LTD	14,549	67.08	975,946.92
MACQUARIE GROUP LIMITED	29,434	162.34	4,778,315.56
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	236,496	4.89	1,156,465.44
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.50	813,801.41
QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.02	1,341,323.82
SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	10.63	1,008,404.32
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	25.21	1,118,718.96
WISETECH GLOBAL LTD	13,801	57.74	796,869.74
XERO LTD	11,340	76.42	866,602.80
TELSTRA CORP	308,467	3.88	1,196,851.96
ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	5.64	854,273.88
オーストラリアドル 小計	5,488,661		121,993,964.28 (11,451,573,426)
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.21	849,849.91

ニュージーランドドル	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	19.60	783,608.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.15	892,423.29
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.20	335,987.60
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.52	499,658.88
ニュージーランドドル 小計		506,126		3,361,527.68 (285,460,930)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	42.30	9,052,030.80
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	75.45	8,073,150.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	11.26	1,936,720.00
	MTR CORP	125,000	34.90	4,362,500.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	15.26	1,831,200.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	40.95	7,125,300.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	15.30	3,029,400.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	14.72	2,534,784.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	18.94	2,763,346.00
	WH GROUP LTD	658,301	4.70	3,094,014.70
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	26.30	7,403,450.00
	HANG SENG BANK	59,400	118.80	7,056,720.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	252.80	24,218,240.00
	AIA GROUP LTD	982,200	68.00	66,789,600.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	45.55	7,492,792.80
	ESR GROUP LTD	157,000	17.74	2,785,180.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	13.02	2,252,460.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	21.45	2,686,140.60
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	18.82	2,566,577.50
	SINO LAND CO	315,400	9.88	3,116,152.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	122,500	89.50	10,963,750.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	57.10	2,312,550.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	16.68	1,604,616.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	36.15	4,301,850.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	36.40	2,457,000.00	
CLP HOLDINGS	137,500	54.20	7,452,500.00	
HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.52	5,898,363.64	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	37.05	4,149,600.00	
香港ドル 小計		6,176,653		209,309,988.04 (3,999,913,871)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.62	746,736.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.26	480,524.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.05	547,076.60
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.77	476,625.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.55	634,030.00
	DBS GROUP	150,000	32.85	4,927,500.00

	OCBC BANK	282,100	11.64	3,283,644.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	26.27	2,466,753.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	8.47	559,020.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.18	710,730.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.45	318,860.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.11	290,225.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	16.00	411,200.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.46	1,675,119.78	
	シンガポールドル 小計	2,774,575		17,528,043.38 (1,845,001,846)	
イスラエルシ ケル	ICL LTD	59,427	30.39	1,805,986.53	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	735.00	1,577,310.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	32.17	3,162,632.70	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	134,557	32.39	4,358,301.23	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.70	1,860,650.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	128.40	1,605,385.20	
	AZRIELI GROUP	4,323	257.00	1,111,011.00	
	NICE LTD	4,991	679.90	3,393,380.90	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	176,957	6.12	1,082,976.84	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	151.00	1,510,000.00	
	イスラエルシケル 小計	602,714		21,467,634.40 (909,551,468)	
	合 計	90,434,201		528,680,823,030 (528,680,823,030)	

(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	AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	38,290	78,877.40	
		アメリカドル 小計	38,290	78,877.40 (11,830,032)	
	オーストラ リアドル	APA GROUP	109,658	1,083,421.04	
		LENDLEASE GROUP	64,786	534,484.50	
	オーストラリアドル 小計	174,444	1,617,905.54 (151,872,793)		
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,102,500.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,879,100.00	
	香港ドル 小計	535,500	3,981,600.00 (76,088,376)		
	投資信託受益証券合計		748,234	239,791,201 (239,791,201)	

投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,110	1,581,444.90	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	786,431.26	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,131	7,091,649.69	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	636,956.06	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	1,964,402.20	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	808,621.38	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	873,544.77	
		CROWN CASTLE INC	35,305	4,614,363.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,230,865.51	
		EQUINIX INC	7,423	3,900,934.96	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	827,505.70	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,592	1,882,938.96	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,182,159.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,803,218.56	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	21,791	992,362.14	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	578,208.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,021,178.40	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	995,230.69	
		INVITATION HOMES INC	51,127	1,661,627.50	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,078,594.24	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	914,832.70	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	550,396.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,357,273.95	
		PROLOGIS INC	74,847	7,635,142.47	
		PUBLIC STORAGE	12,922	3,759,009.80	
		REALTY INCOME CORP	49,865	2,883,692.95	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	679,597.52	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,167,121.67	
		SIMON PROPERTY GROUP	27,091	2,655,730.73	
		SUN COMMUNITIES INC	10,227	1,240,535.10	
		UDR INC	24,265	942,937.90	
		VENTAS INC	31,565	1,171,692.80	
		VICI PROPERTIES INC	80,143	2,356,204.20	
VORNADO REALTY TRUST	11,390	245,910.10			
WELLTOWER INC	37,724	2,238,164.92			
WP CAREY INC	16,024	1,132,896.80			
	アメリカドル 小計	1,000,838	68,443,377.63	(10,265,137,776)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	192,743.28		
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	287,339.50		
	カナダドル 小計	20,377	480,082.78	(52,281,014)	

ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	243,138.00
	GECINA SA	3,139	259,438.35
	KLEPIERRE	17,225	332,873.12
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	460,804.12
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	318,459.24
ユーロ 小計		48,695	1,614,712.83 (236,490,841)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	270,881.15
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	238,666.08
	SEGRO PLC	93,383	668,061.98
イギリスポンド 小計		219,086	1,177,609.21 (197,850,123)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	726,374.80
	GOODMAN GROUP	133,807	2,235,914.97
	GPT GROUP	167,884	676,572.52
	MIRVAC GROUP	266,683	520,031.85
	SCENTRE GROUP	382,183	1,008,963.12
	STOCKLAND	207,412	692,756.08
	VICINITY CENTERS	365,149	657,268.20
オーストラリアドル 小計		1,617,208	6,517,881.54 (611,833,540)
香港ドル	LINK REIT	170,500	8,797,800.00
香港ドル 小計		170,500	8,797,800.00 (168,125,958)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	730,234.66
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	460,429	833,376.49
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	419,119.72
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	352,000.00
シンガポールドル 小計		1,247,756	2,334,730.87 (245,753,771)
投資証券合計		4,324,460	11,777,473,023 (11,777,473,023)
合計			12,017,264,224 (12,017,264,224)

(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 599銘柄	97.5%			72.7%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 36銘柄			2.5%	1.9%
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 224銘柄	99.5%			8.7%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79銘柄	99.2%			4.3%
	投資証券 3銘柄			0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 46銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 50銘柄	93.7%			2.1%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.2%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.0%	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	94.2%			0.7%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	88.2%			0.3%
	投資証券 4銘柄			11.8%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 10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10月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	36,545,420
コール・ローン	3,439,271,950
国債証券	294,597,603,008
派生商品評価勘定	74,727,129
未収入金	9,200,989
未収利息	2,147,373,245
前払金	46,554,359
前払費用	108,952,722
差入委託証拠金	446,233,049
流動資産合計	300,906,461,871
資産合計	300,906,461,871
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	47,290,321
未払解約金	62,678,192
未払利息	6,664
流動負債合計	109,975,177
負債合計	109,975,177
純資産の部	
元本等	
元本	94,626,023,402
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	206,170,463,292
元本等合計	300,796,486,694
純資産合計	300,796,486,694
負債純資産合計	300,906,461,871

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年10月20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>

	2022年10月20日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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> <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) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 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10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	94,626,023,402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 3.1788円 (1万口当たり純資産額) (31,788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10月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年10月20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。</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10月20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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 4月21日
期首元本額	102,152,335,338円
期中追加設定元本額	10,849,170,470円
期中一部解約元本額	18,375,482,406円
期末元本額	94,626,023,402円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,271,461,249円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	551,314,233円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,215,148,393円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,463,527円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,370,587,855円
世界経済インデックスファンド	15,242,013,281円
D C マイセレクション 2 5	1,948,901,355円
D C マイセレクション 5 0	1,691,150,966円
D C マイセレクション 7 5	1,166,565,704円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,318,295,160円
D C マイセレクション S 2 5	973,644,435円
D C マイセレクション S 5 0	774,492,853円
D C マイセレクション S 7 5	440,552,772円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	25,329,827円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	92,908,365円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	48,152,508円
D C 世界経済インデックスファンド	13,317,229,952円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	538,827,204円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,592,694円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,003,475円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	21,572,840円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	39,279,339円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	61,790,159円

区分	2022年10月20日現在
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	71,750,256円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	64,513,682円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,152,249,296円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	417,113,931円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,669,711,887円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	63,786,644円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	36,551,421円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	414,554,643円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	157,543,457円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	202,308,766円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	714,455,622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）	2,743,373,032円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	677,802,405円
外国債券ファンド・シリーズ1	700,502,761円
コア投資戦略ファンド（安定型）	191,540,029円
コア投資戦略ファンド（成長型）	956,949,109円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	590,591,531円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,240,903,087円
コア投資戦略ファンド（切替型）	361,622,266円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	253,087,231円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	108,308,385円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,294,131,835円
SMT インデックスバランス・オープン	198,140,899円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	9,410,454,166円
SMT 世界経済インデックス・オープン	280,727,214円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	353,129,628円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	560,328,001円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,685,973円
グローバル経済コア	857,138,756円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	17,785,870円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,806,425円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	102,830,030円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	18,887,444円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	19,501,216円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	22,226,610円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	9,699,106円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	13,122,138円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	41,260,668円
10資産分散投資ファンド	7,886円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	153,921,331円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	11,129,454,179円

区分	2022年10月20日現在
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	328,802,953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）	281,574,052円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	368,308,868円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	908,964,779円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	100,932,824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）	49,354,601円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	28,296,398,019	
合計	28,296,398,019	

(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10月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,520,560,480	-	3,474,006,121	46,554,359
	合計	3,520,560,480	-	3,474,006,121	46,554,359

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2022年10月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,648,551,844	-	3,722,543,011	73,991,167

	アメリカドル	2,011,673,842	-	2,050,656,798	38,982,956
	カナダドル	148,959,985	-	152,027,820	3,067,835
	ユーロ	1,190,450,820	-	1,215,867,678	25,416,858
	イギリスポンド	169,110,430	-	174,367,024	5,256,594
	オフショア人民元	128,356,767	-	129,623,691	1,266,924
	合計	3,648,551,844	-	3,722,543,011	73,991,167

(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
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,460,937.50	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,439,542.99	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,088,769.54	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,227,871.11	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,335,742.20	
		T 0.25% 05/31/25	10,900,000.00	9,750,816.37	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,374,218.75	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,391,203.14	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,619,265.61	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,622,558.57	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,165,046.88	
		T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,510,800.74	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	6,990,625.04	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,571,250.00	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,205,937.52	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,377,364.29	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,563,496.08	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,632,031.25	
T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,096,878.89			

T 0.375% 09/30/27	3,330,000.00	2,744,388.29	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,638,945.32	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,509,062.52	
T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	3,937,148.46	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,554,688.26	
T 0.5% 04/30/27	11,940,000.00	10,044,058.62	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	2,934,667.96	
T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	5,823,562.49	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	3,878,721.87	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,198,632.85	
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,362,402.32	
T 0.625% 05/15/30	12,000,000.00	9,256,875.00	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	6,931,875.04	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,153,886.77	
T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,703,266.38	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,075,097.65	
T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,483,203.14	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,058,984.37	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,282,812.50	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,633,671.89	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,501,250.00	
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,273,153.54	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,045,075.80	
T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,218,415.81	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,017,812.48	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,223,984.36	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,692,644.58	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,304,343.78	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	11,931,828.12	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	7,851,542.99	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,768,750.00	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,024,396.87	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,085,468.77	
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	8,515,778.12	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,377,701.15	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,782,500.00	
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	4,502,730.51	
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	6,769,687.52	
T 1.25% 06/30/28	4,000,000.00	3,376,875.00	
T 1.25% 08/15/31	13,380,000.00	10,551,384.37	
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,161,875.00	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,163,281.25	

T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,263,537.87
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,727,031.24
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	5,332,078.12
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	2,968,762.50
T 1.375% 11/15/31	21,030,000.00	16,669,560.93
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,717,656.28
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,125,570.33
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,317,968.78
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,381,725.81
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,716,894.55
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,017,724.62
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,259,281.27
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,363,574.20
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,099,718.73
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,055,236.73
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,146,484.37
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,716,406.25
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,428,466.80
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,508,953.13
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,986,367.22
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,277,913.29
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,153,671.86
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	1,966,781.25
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,287,921.87
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,069,421.89
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,559,609.39
T 1.875% 02/15/32	8,020,000.00	6,627,151.60
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,363,359.37
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,074,984.40
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,599,687.52
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,723,508.21
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,709,023.46
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	5,720,953.12
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,807,812.50
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,422,187.52
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	4,931,460.96
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,139,988.27
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	3,980,826.56
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,315,375.00
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,595,812.51
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,774,414.05
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,610,958.59
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,882,109.36

T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,181,558.63	
T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,558,250.00	
T 2.25% 03/31/24	5,900,000.00	5,702,257.84	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	6,962,109.37	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,751,171.91	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,687,032.84	
T 2.25% 08/15/27	11,530,000.00	10,467,978.95	
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	2,854,110.17	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,771,367.21	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,020,683.57	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,690,474.58	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,110,390.63	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	6,913,388.69	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,378,535.14	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,141,812.50	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,037,773.46	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,590,012.49	
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,363,871.10	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,421,453.13	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,706,852.76	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,123,268.00	
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,692,265.62	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,805,078.15	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,892,421.87	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,377,692.58	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,777,734.40	
T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,238,547.66	
T 2.5% 02/15/46	3,950,000.00	2,843,382.80	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,639,546.87	
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,041,507.81	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,417,576.94	
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,082,600.81	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,931,396.50	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,418,857.43	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,489,896.87	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,926,171.89	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,046,724.59	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,187,890.62	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,254,218.75	
T 2.75% 08/15/42	5,800,000.00	4,504,062.50	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,059,015.62	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,565,781.25	

T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,276,545.30
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,036,775.00
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,304,894.54
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,837,968.76
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	6,723,440.62
T 2.875% 05/15/32	6,000,000.00	5,407,031.28
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,268,773.43
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	4,368,968.75
T 2.875% 05/15/52	4,800,000.00	3,762,750.00
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,660,634.37
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,223,044.51
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,619,415.61
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,783,218.75
T 2.875% 10/31/23	7,900,000.00	7,770,853.48
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	1,935,351.57
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	3,947,058.98
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	7,982,803.12
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,210,546.90
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	5,984,937.09
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,174,044.33
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,265,175.79
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,424,925.00
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,991,496.13
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,286,626.61
T 2% 11/15/41	8,200,000.00	5,624,046.91
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	876,750.00
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,646,093.76
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	4,844,532.06
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,498,881.25
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,853,015.60
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,461,386.72
T 3.25% 05/15/42	1,750,000.00	1,488,320.31
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,560,616.42
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,558,000.00
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	705,933.59
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,130,375.00
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,783,593.76
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	1,843,125.00
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,723,437.50
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,373,648.43
T 3% 02/15/47	800,000.00	633,437.50
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	3,538,097.67
T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,019,531.25

T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,319,667.19	
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	1,984,765.62	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,542,420.31	
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,596,445.31	
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,201,031.27	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,021,335.94	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,781,445.30	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,228,406.26	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	904,148.44	
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,338,617.18	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,026,328.13	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,926,867.19	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	1,965,539.06	
T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,009,718.76	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,142,030.47	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	571,957.03	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,759,632.82	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,446,304.69	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	795,351.56	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,206,218.75	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,360,023.44	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,109,046.87	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,775,039.07	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,561,242.18	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,184,121.09	
アメリカドル 小計	1,193,000,000.00	1,030,963,251.55 (154,623,868,467)	
カナダドル			
CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,016,796.80	
CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,268,096.00	
CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,243,730.40	
CAN 0.5% 12/01/30	3,360,000.00	2,635,987.20	
CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,243,372.00	
CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	655,970.00	
CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,347,552.00	
CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,680,122.60	
CAN 1.25% 06/01/30	3,180,000.00	2,691,965.40	
CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,371,363.40	
CAN 1.5% 05/01/24	1,590,000.00	1,525,875.30	
CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,252,641.60	
CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,362,312.10	
CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,143,576.00	
CAN 1.5% 12/01/31	4,320,000.00	3,632,083.20	

	CAN 1.75% 12/01/53	2,520,000.00	1,677,160.80	
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	718,567.20	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,374,154.20	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,239,924.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,223,641.60	
	CAN 2.25% 06/01/29	760,000.00	701,654.80	
	CAN 2.25% 12/01/29	510,000.00	468,735.90	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,295,247.10	
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	819,294.00	
	CAN 2.75% 09/01/27	760,000.00	727,798.80	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	903,682.50	
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	631,438.40	
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	376,958.10	
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,128,930.60	
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,388,609.50	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,030,669.50	
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,110,730.40	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,099,570.50	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,020,000.00	1,150,131.60	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,120,000.00	1,331,556.80	
	CAN 5% 06/01/37	880,000.00	1,013,267.20	
	カナダドル 小計	62,160,000.00	55,483,167.50 (6,042,116,940)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,605,917.00	
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,291,072.00	
	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,508,625.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	39,700,467.30	
	MBONO 5% 03/06/25	5,200,000.00	4,612,504.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	35,392,925.10	
	MBONO 7.75% 05/29/31	39,930,000.00	35,000,641.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	23,169,808.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,514,092.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	24,390,000.00	22,748,309.10	
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	23,568,012.30	
	MBONO 8% 07/31/53	3,700,000.00	3,025,157.00	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,004,335.60	
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	23,410,688.00	
	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,229,004.90	
	メキシコペソ 小計	365,140,000.00	328,781,559.80 (2,450,770,624)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,040,000.00	852,363.20	
	BGB 0.2% 10/22/23	630,000.00	619,113.60	
	BGB 0.35% 06/22/32	1,550,000.00	1,211,356.00	

BGB 0.4% 06/22/40	1,010,000.00	610,827.80
BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,375,582.40
BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	261,753.60
BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,583,546.80
BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,564,297.80
BGB 0.8% 06/22/28	1,460,000.00	1,322,336.60
BGB 0.9% 06/22/29	2,140,000.00	1,907,617.40
BGB 0% 10/22/27	780,000.00	686,875.80
BGB 0% 10/22/31	1,180,000.00	912,470.40
BGB 1.25% 04/22/33	740,000.00	627,564.40
BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	659,295.00
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	627,088.00
BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	878,800.40
BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	914,810.00
BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	869,568.00
BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,392,241.40
BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,783,822.50
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	670,991.20
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	611,233.70
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,157,162.80
BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	370,260.00
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	978,536.70
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,015,610.90
BGB 4.25% 03/28/41	1,730,000.00	1,919,954.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,220,620.80
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,174,316.40
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,194,748.20
BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	2,693,040.00
BKO 0.2% 06/14/24	500,000.00	485,580.00
BKO 0.4% 09/13/24	1,300,000.00	1,259,921.00
BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,802,196.00
BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,840,275.60
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,372,408.80
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	543,570.20
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,647,099.00
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,727,824.20
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	1,866,681.60
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,270,207.20
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	657,196.30
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	1,998,090.00
BTPS 0.9% 04/01/31	3,830,000.00	2,875,717.20
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	629,758.20
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	1,836,943.50

BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,728,294.60	
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,296,970.50	
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,571,958.40	
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	965,800.00	
BTPS 0% 01/30/24	1,630,000.00	1,572,884.80	
BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,406,990.40	
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,874,600.00	
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,245,709.40	
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,420,545.00	
BTPS 0% 11/29/23	1,750,000.00	1,698,165.00	
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,712,863.00	
BTPS 1.1% 04/01/27	1,000,000.00	888,780.00	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,769,040.00	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,579,179.40	
BTPS 1.45% 03/01/36	700,000.00	485,009.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,192,567.00	
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,322,408.00	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	705,150.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,297,983.20	
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,637,786.40	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,643,397.00	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,064,054.80	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	922,992.00	
BTPS 1.75% 05/30/24	1,910,000.00	1,870,864.10	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	979,370.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	1,360,000.00	871,950.40	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,407,100.50	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,590,218.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,525,786.80	
BTPS 2.1% 07/15/26	900,000.00	851,985.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	380,000.00	210,501.00	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	613,805.40	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,125,986.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,850,000.00	2,155,483.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,135,179.20	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,189,912.10	
BTPS 2.5% 11/15/25	1,250,000.00	1,214,937.50	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,911,207.50	
BTPS 2.5% 12/01/32	1,250,000.00	1,031,812.50	
BTPS 2.65% 12/01/27	960,000.00	897,974.40	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,710,000.00	1,229,165.10	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	749,687.20	

BTPS 2.8% 06/15/29	1,820,000.00	1,664,626.60
BTPS 2.8% 12/01/28	2,020,000.00	1,882,478.40
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	943,067.80
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,049,458.40
BTPS 2% 12/01/25	1,490,000.00	1,425,363.80
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,142,432.60
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	799,324.80
BTPS 3.25% 09/01/46	1,970,000.00	1,572,355.50
BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,583,054.20
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	1,738,378.80
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	3,776,889.60
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,176,767.50
BTPS 3.85% 09/01/49	1,260,000.00	1,097,170.20
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,019,098.20
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,808,080.00
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,144,168.00
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,723,628.00
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,094,225.00
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,302,920.00
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,071,550.00
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	3,804,572.00
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,481,688.80
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,803,142.60
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,046,536.90
BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,292,259.20
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,036,536.00
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,269,207.60
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,593,060.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	850,792.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,595,176.90
DBR 0.25% 02/15/29	2,410,000.00	2,135,525.10
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,353,692.20
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,975,618.80
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,852,460.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,860,000.00	2,622,705.80
DBR 0.5% 08/15/27	2,930,000.00	2,713,590.20
DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,100,982.00
DBR 0% 02/15/31	2,030,000.00	1,685,915.00
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	2,954,461.80
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,747,872.00
DBR 0% 05/15/36	2,730,000.00	1,952,932.80
DBR 0% 08/15/26	2,350,000.00	2,172,880.50
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,012,170.00

DBR 0% 08/15/30	3,830,000.00	3,221,298.10	
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	564,093.10	
DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,589,081.00	
DBR 0% 08/15/50	4,580,000.00	2,417,140.80	
DBR 0% 08/15/52	1,790,000.00	899,492.90	
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,655,090.40	
DBR 0% 11/15/28	1,720,000.00	1,508,354.00	
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	2,826,660.60	
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,275,412.70	
DBR 1.7% 08/15/32	1,550,000.00	1,459,728.00	
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,647,591.00	
DBR 1% 05/15/38	800,000.00	642,848.00	
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	1,966,340.00	
DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,538,735.20	
DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	3,363,192.00	
DBR 2.5% 08/15/46	3,210,000.00	3,252,307.80	
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,476,950.20	
DBR 4.0% 01/04/37	3,190,000.00	3,750,100.20	
DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	2,635,577.50	
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	2,887,951.50	
DBR 4.75% 07/04/34	2,230,000.00	2,759,335.10	
DBR 4.75% 07/04/40	2,030,000.00	2,662,040.50	
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,521,600.00	
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,747,205.20	
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,396,829.50	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,579,250.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,231,785.60	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,282,808.40	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,336,605.30	
FRTR 0.5% 05/25/26	3,550,000.00	3,318,575.50	
FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,449,100.50	
FRTR 0.5% 05/25/40	3,210,000.00	2,022,235.80	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	374,210.10	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,152,716.40	
FRTR 0.75% 02/25/28	2,150,000.00	1,952,759.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	5,693,519.30	
FRTR 0.75% 05/25/52	2,780,000.00	1,499,393.00	
FRTR 0.75% 05/25/53	2,660,000.00	1,401,607.20	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,256,108.00	
FRTR 0% 02/25/24	2,850,000.00	2,774,104.50	
FRTR 0% 02/25/25	2,500,000.00	2,369,150.00	
FRTR 0% 02/25/26	4,460,000.00	4,121,173.80	

FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,102,130.40
FRTR 0% 03/25/24	4,260,000.00	4,138,334.40
FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,532,010.60
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,508,609.60
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,365,537.00
FRTR 0% 11/25/30	6,630,000.00	5,331,779.70
FRTR 0% 11/25/31	5,790,000.00	4,523,727.00
FRTR 1.25% 05/25/34	4,390,000.00	3,617,799.00
FRTR 1.25% 05/25/36	4,750,000.00	3,746,277.50
FRTR 1.5% 05/25/31	6,170,000.00	5,611,183.10
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	2,464,965.80
FRTR 1.75% 05/25/66	1,380,000.00	935,750.40
FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,376,471.20
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,121,020.80
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,349,563.50
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,075,928.00
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,105,658.00
FRTR 2.5% 05/25/30	4,980,000.00	4,938,317.40
FRTR 2.5% 05/25/43	520,000.00	457,891.20
FRTR 2.75% 10/25/27	6,580,000.00	6,642,707.40
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	2,789,117.60
FRTR 2% 11/25/32	1,220,000.00	1,120,496.80
FRTR 3.25% 05/25/45	2,900,000.00	2,890,169.00
FRTR 3.5% 04/25/26	5,600,000.00	5,808,208.00
FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,774,639.00
FRTR 4.5% 04/25/41	3,920,000.00	4,526,032.00
FRTR 4.75% 04/25/35	2,940,000.00	3,413,516.40
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	2,759,332.40
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,329,364.10
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	3,661,066.90
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,030,546.50
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,384,985.20
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,101,761.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	840,561.90
IRISH 0.2% 10/18/30	960,000.00	787,862.40
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	367,497.70
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	442,609.90
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	310,455.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	703,387.30
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	664,453.50
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,091,292.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	570,424.60
IRISH 1.35% 03/18/31	790,000.00	713,923.00

IRISH 1.5% 05/15/50	880,000.00	598,980.80
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	479,903.60
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	956,520.00
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,190,809.40
IRISH 2% 02/18/45	1,100,000.00	877,789.00
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	987,615.20
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,245,700.80
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,192,305.50
NETHER 0.25% 07/15/29	750,000.00	646,552.50
NETHER 0.5% 01/15/40	1,780,000.00	1,219,300.00
NETHER 0.5% 07/15/26	1,420,000.00	1,330,369.60
NETHER 0.5% 07/15/32	900,000.00	733,059.00
NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,447,508.40
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,547,136.00
NETHER 0% 01/15/24	1,630,000.00	1,590,211.70
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,105,438.60
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,666,267.20
NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,188,811.40
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	628,032.00
NETHER 0% 01/15/52	1,410,000.00	669,750.00
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,112,994.00
NETHER 0% 07/15/31	1,490,000.00	1,196,619.00
NETHER 2.5% 01/15/33	1,630,000.00	1,597,954.20
NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,332,702.80
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	1,987,990.10
NETHER 3.75% 01/15/42	1,870,000.00	2,111,435.70
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,454,091.40
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	1,989,154.00
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,238,591.50
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,861,332.10
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,190,387.50
OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	999,295.00
OBL 0% 10/09/26	3,900,000.00	3,584,061.00
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,296,930.00
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,482,457.60
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,315,118.30
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	403,266.00
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,223,513.40
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	990,602.90
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	115,040.80
RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,093,973.10
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	434,577.00

RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	1,941,451.20
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	132,141.90
RAGB 0.9% 02/20/32	880,000.00	725,595.20
RAGB 0% 02/20/30	1,210,000.00	979,579.70
RAGB 0% 02/20/31	1,430,000.00	1,120,376.40
RAGB 0% 04/20/25	960,000.00	907,718.40
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,391,256.00
RAGB 0% 10/20/28	450,000.00	381,082.50
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	376,479.70
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,034,101.50
RAGB 1.5% 02/20/47	880,000.00	632,711.20
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	153,640.80
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	981,515.70
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,328,217.80
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	353,965.40
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	566,821.80
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	677,294.00
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	828,871.20
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	470,752.80
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	1,996,121.40
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,481,476.90
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,370,180.60
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	294,280.80
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	205,877.60
RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	421,869.60
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	301,360.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	580,809.80
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	296,469.60
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	784,914.00
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	568,464.00
RFGB 0.5% 09/15/29	550,000.00	469,683.50
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	670,408.00
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	420,948.00
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	403,250.40
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	271,605.00
RFGB 0% 09/15/30	520,000.00	414,845.60
RFGB 1.125% 04/15/34	430,000.00	347,564.70
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	331,324.00
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	354,784.50
RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	425,045.60
RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	475,597.20
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	549,274.00
RFGB 2% 04/15/24	570,000.00	569,743.50

RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	867,358.30
SPGB 0.1% 04/30/31	2,700,000.00	2,067,930.00
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,209,277.50
SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	2,803,470.00
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,007,761.10
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,028,423.40
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,718,112.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,218,008.80
SPGB 0.8% 07/30/29	740,000.00	634,624.00
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	976,331.20
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,157,906.00
SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,499,462.40
SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,382,815.20
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,650,400.90
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,035,116.10
SPGB 0% 05/31/25	990,000.00	926,055.90
SPGB 1.2% 10/31/40	2,810,000.00	1,850,019.70
SPGB 1.25% 10/31/30	1,950,000.00	1,679,535.00
SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,027,130.00
SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	1,997,419.90
SPGB 1.4% 07/30/28	3,030,000.00	2,771,177.40
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,434,880.40
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	2,832,793.60
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	305,632.80
SPGB 1.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,887,600.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	2,986,468.50
SPGB 1.85% 07/30/35	2,000,000.00	1,638,860.00
SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	580,509.00
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,247,813.00
SPGB 1.95% 07/30/30	2,740,000.00	2,504,771.00
SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	550,536.20
SPGB 1% 10/31/50	2,330,000.00	1,206,077.90
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,780,691.70
SPGB 2.35% 07/30/33	2,150,000.00	1,932,377.00
SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,824,154.20
SPGB 2.7% 10/31/48	1,760,000.00	1,431,936.00
SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,360,003.50
SPGB 2.9% 10/31/46	1,800,000.00	1,544,202.00
SPGB 3.45% 07/30/43	570,000.00	532,112.10
SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,588,543.20
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,578,010.40
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	2,675,778.60

	SPGB 4.4% 10/31/23	2,590,000.00	2,647,498.00
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,007,219.20
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,590,000.00	1,790,196.90
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,840,000.00	1,899,045.60
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,030,000.00	2,336,469.10
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	3,889,849.30
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,086,381.80
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,430,827.40
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,303,698.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,230,169.50
	ユーロ 小計	723,570,000.00	663,480,626.50 (97,173,372,557)
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,121,563.80
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,165,030.00
	UKT 0.125% 01/31/28	1,460,000.00	1,201,054.40
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,735,247.20
	UKT 0.25% 07/31/31	2,370,000.00	1,730,716.20
	UKT 0.375% 10/22/26	2,970,000.00	2,591,681.40
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,637,354.00
	UKT 0.5% 01/31/29	1,930,000.00	1,563,531.60
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	493,347.80
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,576,903.00
	UKT 0.625% 07/31/35	1,910,000.00	1,258,690.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	470,693.00
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	606,890.70
	UKT 0.875% 07/31/33	1,260,000.00	917,267.40
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,393,014.00
	UKT 1.125% 01/31/39	820,000.00	525,907.00
	UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	237,952.00
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	843,742.50
	UKT 1.25% 07/31/51	1,710,000.00	913,345.20
	UKT 1.25% 10/22/41	2,460,000.00	1,525,716.60
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,475,792.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,423,564.20
	UKT 1.5% 07/31/53	420,000.00	238,274.40
	UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	944,649.50
	UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	785,508.00
	UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	852,095.20
UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	822,900.00	
UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	1,351,503.40	
UKT 1.75% 09/07/37	2,190,000.00	1,611,642.90	
UKT 1% 01/31/32	2,190,000.00	1,691,052.30	
UKT 1% 04/22/24	800,000.00	771,600.00	

	UKT 2.5% 07/22/65	1,820,000.00	1,369,076.80
	UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,667,573.70
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,707,589.60
	UKT 3.25% 01/22/44	2,410,000.00	2,095,374.50
	UKT 3.5% 01/22/45	2,120,000.00	1,912,939.60
	UKT 3.5% 07/22/68	1,830,000.00	1,782,035.70
	UKT 3.75% 07/22/52	1,100,000.00	1,055,780.00
	UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	1,669,323.20
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,163,315.00
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	1,625,394.60
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,389,769.10
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	1,756,440.00
	UKT 4.25% 12/07/46	1,320,000.00	1,339,153.20
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,553,654.10
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,035,105.00
	UKT 4.5% 09/07/34	1,570,000.00	1,641,293.70
	UKT 4.5% 12/07/42	2,050,000.00	2,135,649.00
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,554,301.40
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	1,759,180.50
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,307,337.50
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,216,532.80
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,389,600.00
	イギリスポンド 小計	88,360,000.00	74,604,648.70 (12,534,327,028)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,391,774.50
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,880,042.10
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	6,770,509.20
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,407,500.00
	SGB 1% 11/12/26	9,640,000.00	9,117,030.00
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,524,105.60
	SGB 2.5% 05/12/25	6,360,000.00	6,370,112.40
	SGB 3.5% 03/30/39	4,440,000.00	5,276,407.20
	スウェーデンクローナ 小計	58,910,000.00	56,737,481.00 (756,877,996)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,340,000.00	3,561,404.00
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,487,847.20
	NGB 1.5% 02/19/26	4,820,000.00	4,501,831.80
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,914,653.50
	NGB 1.75% 03/13/25	6,570,000.00	6,293,797.20
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,768,305.00
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	2,948,332.80
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,611,271.60

	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,707,387.20
ノルウェークローネ 小計		46,830,000.00	42,794,830.30 (603,407,107)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,210,000.00	3,178,402.20
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,189,797.00
	DGB 0.5% 11/15/29	8,280,000.00	7,153,174.80
	DGB 0% 11/15/24	3,840,000.00	3,658,790.40
	DGB 0% 11/15/31	6,960,000.00	5,447,244.00
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,505,379.50
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,405,805.90
	DGB 4.5% 11/15/39	12,270,000.00	14,917,988.70
デンマーククローネ 小計		57,470,000.00	53,456,582.50 (1,052,560,109)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,290,000.00	1,657,066.90
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	2,950,314.40
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,862,848.80
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,485,808.50
	POLGB 1.75% 04/25/32	1,810,000.00	1,049,655.20
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,482,608.80
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,258,190.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,650,000.00	6,168,654.00
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,260,000.00	3,284,758.20
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,910,000.00	2,962,216.00
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,412,779.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,180,000.00	2,767,554.00
	POLGB 3.75% 05/25/27	1,390,000.00	1,141,607.00
	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,313,479.50
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	523,896.00
ポーランドズロチ 小計		51,070,000.00	40,321,436.30 (1,229,021,571)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,230,000.00	2,086,298.80
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,895,691.00
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,810,000.00	2,487,102.90
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,142,378.60
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,170,000.00	1,777,425.30
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,143,171.30
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,400,000.00	1,950,720.00
	ACGB 1% 11/21/31	3,610,000.00	2,790,132.90
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,874,996.40
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,366,602.40
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,760,000.00	2,503,623.60
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,368,656.40
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,297,659.30

	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,033,644.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,841,084.90	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,564,400.60	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,310,679.60	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,542,643.20	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,124,540.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	977,334.40	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,150,000.00	1,088,636.00	
	ACGB 3% 03/21/47	1,360,000.00	1,086,272.80	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,665,604.80	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,130,000.00	2,172,429.60	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,402,284.50	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,419,852.80	
	オーストラリアドル 小計	52,830,000.00	46,913,866.10 (4,403,804,610)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	685,590.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	740,129.40	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	556,549.50	
	SIGB 1.875% 03/01/50	590,000.00	449,762.90	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	244,438.40	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,028,419.20	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	778,456.30	
	SIGB 2.375% 06/01/25	940,000.00	914,986.60	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	378,481.70	
	SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	581,232.40	
	SIGB 2.625% 08/01/32	350,000.00	324,152.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	705,652.40	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	584,577.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	623,044.50	
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	600,616.80	
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	668,168.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	821,799.60	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	738,386.80	
	SIGB 3% 08/01/72	280,000.00	273,649.60	
SIGB 3% 09/01/24	1,280,000.00	1,272,153.60		
	シンガポールドル 小計	13,900,000.00	12,970,247.20 (1,365,248,220)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,800,000.00	1,558,134.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,917,696.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,467,085.80	
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	662,799.20	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,505,825.20	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,830,000.00	1,583,261.10	

	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,633,851.60
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,561,984.40
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,370,137.00
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,450,680.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,117,603.90
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,940,292.40
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,100,877.60
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	595,638.00
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,120,998.40
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,291,123.20
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,012,166.00
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,292,646.40
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,433,775.80
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,671,845.00
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,525,275.00
	MGS 4.498% 04/15/30	580,000.00	580,174.00
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,771,416.00
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,029,577.50
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,422,960.80
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,313,744.00
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,320,995.60
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,653,170.40
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,023,202.00
	マレーシアリングット 小計	50,460,000.00	48,928,936.30 (1,552,309,647)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,010,000.00	955,531.20
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,028,689.28
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,261,166.68
	ILGOV 1.3% 04/30/32	950,000.00	788,540.55
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,970,000.00	1,506,841.96
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,197,029.22
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,188,617.74
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,386,874.07
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	1,876,228.67
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,595,193.42
	ILGOV 3.75% 03/31/24	3,030,000.00	3,057,523.91
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,656,077.78
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,672,852.86
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,482,554.02
	イスラエルシェケル 小計	27,720,000.00	26,653,721.36 (1,129,278,193)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	48,520,000.00	48,251,684.40

CGB 2.18% 06/25/24	22,500,000.00	22,560,075.00	
CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,746,657.00	
CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,734,318.40	
CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,011,600.00	
CGB 2.56% 10/21/23	18,440,000.00	18,580,512.80	
CGB 2.68% 05/21/30	15,030,000.00	14,988,968.10	
CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,430,157.20	
CGB 2.75% 02/17/32	11,500,000.00	11,482,635.00	
CGB 2.75% 06/15/29	18,500,000.00	18,585,100.00	
CGB 2.8% 03/24/29	19,750,000.00	19,914,715.00	
CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,807,391.50	
CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	30,017,835.60	
CGB 2.89% 11/18/31	18,510,000.00	18,708,242.10	
CGB 2.91% 10/14/28	10,720,000.00	10,904,705.60	
CGB 3.01% 05/13/28	10,930,000.00	11,200,626.80	
CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,147,008.30	
CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	47,887,383.60	
CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,127,425.00	
CGB 3.28% 12/03/27	19,110,000.00	19,866,182.70	
CGB 3.39% 03/16/50	10,420,000.00	10,831,069.00	
CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	7,988,784.00	
CGB 3.72% 04/12/51	7,390,000.00	8,142,671.50	
CGB 3.81% 09/14/50	8,860,000.00	9,899,898.20	
CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,456,295.40	
CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,769,490.60	
オフショア人民元 小計	459,620,000.00	469,041,432.80 (9,680,639,939)	
合計		294,597,603,008 (294,597,603,008)	

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。
- 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。
- 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 214銘柄	100.0%	52.5%
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%	33.0%
イギリスポンド	国債証券 53銘柄	100.0%	4.3%

スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券	26銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券	20銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリンギット	国債証券	29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券	26銘柄	100.0%	3.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,291,265,537
コール・ローン	33,720,028
株式	104,477,588,279
投資信託受益証券	282,037,875
投資証券	116,247,810
派生商品評価勘定	258,930
未収入金	1,315,518
未収配当金	92,672,203
前払金	562,698,714
差入委託証拠金	514,725,672
流動資産合計	111,372,530,566
資産合計	111,372,530,566
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	562,857,589
未払解約金	7,405,766
未払利息	65
流動負債合計	570,263,420
負債合計	570,263,420
純資産の部	
元本等	
元本	32,230,401,488
剰余金	

	2022年10月20日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	78,571,865,658
元本等合計	110,802,267,146
純資産合計	110,802,267,146
負債純資産合計	111,372,530,566

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</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 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 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10月20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10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	32,230,401,488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 3.4378円 (1万口当たり純資産額) (34,378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10月20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10月20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10月20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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 4月21日
期首元本額	29,748,283,292円
期中追加設定元本額	2,858,851,838円
期中一部解約元本額	376,733,642円
期末元本額	32,230,401,488円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,962,913,975円
世界経済インデックスファンド	6,496,309,808円
D C 新興国株式インデックス・オープン	5,582,557,761円
D C 世界経済インデックスファンド	5,617,298,776円
新興国株式インデックス・オープン（S M A専用）	141,784,236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	1,368,906,511円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	796,419,289円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	637,094,176円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	341,676,057円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	16,373,785円
S M T インデックスバランス・オープン	84,001,103円
S M T 世界経済インデックス・オープン	177,396,948円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	704,588,398円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	119,710,024円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	4,973,410円
グローバル経済コア	359,294,689円
M y S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	62,540,514円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	32,746,331円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	28,341,244円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,968,241円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	13,574,021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）	1,165,020,966円

区分	2022年10月20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）	197,372,761円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	64,232,147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）	9,583,023円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	32,897,129,288	
投資信託受益証券	17,576,545	
投資証券	492,910	
合計	32,879,059,833	

(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10月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引					
	買建	6,476,293,129	-		5,913,594,415	562,698,714
合計		6,476,293,129	-		5,913,594,415	562,698,714

(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10月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	22,530,440	-		22,627,466	97,026
	アメリカドル	22,530,440	-		22,627,466	97,026

	売建	3,135,740	-	3,132,711	3,029
	ブラジルリアル	3,135,740	-	3,132,711	3,029
	合計	25,666,180	-	25,760,177	100,055

(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	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.63	227,640.20	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	6.38	108,013.40	
	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	46.41	537,010.11	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	53,727	22.23	1,194,351.21	
	LI AUTO INC - ADR	67,571	16.80	1,135,192.80	
	NIO INC - ADR	171,200	10.92	1,869,504.00	
	XPENG INC - ADR	53,231	7.67	408,281.77	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	24,287	28.72	697,522.64	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	3.83	157,252.14	
	TRIP.COM GROUP LTD	67,056	22.62	1,516,806.72	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	50,479	45.10	2,276,602.90	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	27.19	333,974.77	
	IQIYI INC-ADR	28,984	2.13	61,735.92	
	JOYY INC	6,185	24.54	151,779.90	
	KANZHUN LTD	22,125	14.48	320,370.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	3.81	432,614.07	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	12.73	66,819.77	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	-	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-	
PINDUODUO INC-ADR	62,365	54.49	3,398,268.85		
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	7.37	388,878.05		

	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	-
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	68,136	1.06	72,224.16
	BEIGENE LTD-ADR	6,085	154.88	942,444.80
	HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	8.45	61,203.35
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	3,311	45.01	149,028.11
	ZAI LAB LTD-ADR	12,825	27.01	346,403.25
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	284,756	1.17	333,734.03
	CREDICORP LTD	8,778	132.08	1,159,398.24
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-
	360 DIGITECH INC	8,061	12.46	100,440.06
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	1.73	197,450.09
	KE HOLDINGS INC	80,573	11.20	902,417.60
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.78	119,049.39
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	24,700	2.95	73,062.60
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	49.10	384,698.50
	アメリカドル 小計	1,891,490		20,124,173.40 (3,018,223,526)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,063,461	6.80	14,031,534.80
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	377,892	63.81	24,113,288.52
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	194.32	2,817,640.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	34.29	3,321,055.08
	ALFA S.A.B. -A	313,500	12.41	3,890,535.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	74.42	2,790,750.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	430.75	10,038,628.75
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	293.15	12,804,792.00
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	137.10	5,852,113.50
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	288,490	20.78	5,994,822.20
	WALMART DE MEXICO-SER V	629,280	71.21	44,811,028.80
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	145.72	7,355,217.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	242,440	130.17	31,558,414.80
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	203.91	5,293,503.60
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	70.14	12,751,452.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	26.56	4,828,608.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	324,600	150.59	48,881,514.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	35.97	9,082,425.00
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,513,640	16.94	59,521,061.60
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	74,800	19.19	1,435,412.00
	SITIOS LATINOAMERICA SAB DE	175,682	5.65	992,603.30
	メキシコペソ 小計	8,954,842		312,166,399.95 (2,326,919,561)
ブラジルリアル	COSAN SA	118,300	16.46	1,947,218.00
	PETRO RIO SA	84,700	33.43	2,831,521.00

PETROBRAS - PETROLEO BRAS	475,700	39.14	18,618,898.00
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	576,440	35.42	20,417,504.80
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	13.18	996,408.00
BRASKEM SA-PREF A	19,300	34.82	672,026.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	12.87	1,279,278.00
GERDAU SA-PREF	141,800	25.81	3,659,858.00
SUZANO SA	90,079	49.22	4,433,688.38
VALE SA	493,487	71.11	35,091,860.57
WEG SA	217,544	34.65	7,537,899.60
CCR SA	125,600	12.38	1,554,928.00
LOCALIZA RENT A CAR	92,452	69.18	6,395,829.36
LOCALIZA RENT A CAR SA-RIGHT	283	18.80	5,320.40
RUMO SA	159,700	20.70	3,305,790.00
AMERICANAS SA	73,040	16.41	1,198,586.40
LOJAS RENNER S.A.	115,947	29.35	3,403,044.45
MAGAZINE LUIZA SA	305,500	4.19	1,280,045.00
VIBRA ENERGIA SA	173,000	18.25	3,157,250.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	18.81	780,615.00
RAIA DROGASIL SA	122,500	23.38	2,864,050.00
AMBEV SA	628,600	14.89	9,359,854.00
BRF SA	52,500	15.11	793,275.00
JBS SA	110,000	25.68	2,824,800.00
NATURA &CO HOLDING SA	100,308	14.13	1,417,352.04
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	510,254	7.36	3,755,469.44
REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,600	29.70	1,354,320.00
HYPERA SA	54,500	48.74	2,656,330.00
BANCO BRADESCO S.A.	326,023	16.70	5,444,584.10
BANCO BRADESCO SA-PREF	584,982	20.07	11,740,588.74
BANCO DO BRASIL S.A.	116,000	41.65	4,831,400.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	575,881	29.60	17,046,077.60
ITAUSA SA	528,325	10.39	5,489,296.75
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	799,809	14.25	11,397,278.25
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	28.99	2,000,310.00
TOTVS SA	57,900	31.58	1,828,482.00
TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	40.71	2,129,133.00
TIM SA	96,100	12.74	1,224,314.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	50.05	1,851,850.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	105,500	47.36	4,996,480.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	11.05	2,340,688.35
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	56.81	2,868,905.00
CPFL ENERGIA SA	27,200	34.29	932,688.00
ENGIE BRASIL SA	46,250	38.70	1,789,875.00

	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	28.23	4,660,773.00	
	ブラジルリアル 小計	8,953,331		226,165,743.23 (6,431,113,375)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,190.00	276,878,700.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,375.00	186,951,875.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	18,037	88,700.00	1,599,881,900.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	62.50	153,824,250.00	
	FALABELLA SA	70,837	1,790.00	126,798,230.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,190.00	164,205,720.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	5,199.00	38,394,615.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	86.50	420,618,360.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,193	25,600.00	158,540,800.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	33.60	211,001,985.60	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	104.50	364,842,417.50	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	29.69	76,044,343.82	
	チリペソ 小計	20,077,377		3,777,983,196.92 (580,989,589)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,314.00	1,131,497,406.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	34,460.00	1,012,296,960.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	30,330.00	1,867,266,450.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	19,100.00	964,760,100.00	
	コロンビアペソ 小計	630,431		4,975,820,916.00 (154,096,197)	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	9,898	16.04	158,763.92	
	OPAP SA	18,496	12.41	229,535.36	
	JUMBO SA	19,341	13.73	265,551.93	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	0.90	237,301.20	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	0.95	268,862.47	
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	3.47	255,972.64	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	15.64	409,877.48	
	PUBLIC POWER CORP	20,834	5.81	121,045.54	
	ユーロ 小計	714,859		1,946,910.54 (285,144,517)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	360.00	4,177,080.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	29.74	3,472,293.70	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	32.76	3,261,782.16	
	KOC HOLDING AS	89,884	56.35	5,064,963.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	30.68	9,165,588.64	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	97.40	8,436,301.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	366.20	2,380,666.20	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	141.30	6,051,031.20	
	AKBANK T.A.S.	276,321	15.71	4,341,002.91	

	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	32.86	6,945,683.92	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	10.10	3,883,076.30	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	25.34	3,625,925.94	
	トルコリラ 小計	1,767,743		60,805,395.37 (490,881,956)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	22,644	677.00	15,329,988.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	72.20	4,383,262.00	
	CEZ AS	17,997	740.00	13,317,780.00	
	チェココルナ 小計	101,351		33,031,030.00 (197,129,187)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,434.00	108,368,982.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	7,710.00	117,022,380.00	
	OTP BANK NYRT	38,695	8,986.00	347,713,270.00	
	ハンガリーフォリント 小計	98,396		573,104,632.00 (202,960,993)	
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	46,330	50.40	2,335,032.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	200,051	4.61	922,235.11	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	88.54	1,787,268.44	
	LPP SA	124	7,780.00	964,720.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	118.72	795,898.88	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	16.60	599,226.80	
	ALLEGRO.EU SA	39,203	19.91	780,688.54	
	DINO POLSKA SA	5,945	294.40	1,750,208.00	
	BANK PEKAO SA	27,684	70.20	1,943,416.80	
	M BANK SA	1,423	204.00	290,292.00	
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	23.21	3,024,193.37	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	222.00	1,630,146.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	48,568	24.60	1,194,772.80	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	5.72	318,363.76	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	4.95	314,559.18	
	ポーランドズロチ 小計	689,110		18,651,021.68 (568,494,331)	
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	
	TATNEFT PJSC	179,460	0.00	0.01	
	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	-
	ロシアグループ 小計	760,525,356		76.00 (186)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	6.83	2,247,070.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	116,000	7.93	919,880.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,343,400	3.39	11,334,126.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	460,000	23.95	11,017,000.00
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	236,000	2.94	693,840.00
	PETROCHINA CO LTD-H	2,648,000	3.32	8,791,360.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	196,000	26.55	5,203,800.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.57	873,800.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	24.50	3,540,250.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	6.29	1,377,510.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	5.62	2,315,440.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	3.54	1,019,520.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	2.73	2,211,300.00
	DONGYUE GROUP	147,000	8.12	1,193,640.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	54.20	2,928,968.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	67,000	8.97	600,990.00
	MMG LIMITED	304,000	1.70	516,800.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	4.82	621,780.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	4,750	12.24	58,140.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	6.04	1,093,240.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	7.61	5,547,690.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.25	893,750.00
	BOC AVIATION LTD	23,800	54.35	1,293,530.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	2.44	478,240.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	14.42	3,504,060.00
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	6.94	888,320.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	3.83	2,703,980.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	7.45	1,266,500.00
	CITIC LTD	617,000	7.36	4,541,120.00
	CRRC CORP LTD-H	409,000	2.61	1,067,490.00
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.83	1,391,040.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	15.30	1,193,400.00
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	7.02	1,123,200.00
	SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	7.21	392,945.00
	WEICHAH POWER CO LTD-H	211,800	7.78	1,647,804.00
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	9.13	1,289,302.08

ZHUZHOU CRRR TIMES ELECTRIC	62,300	32.75	2,040,325.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	2.73	317,226.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	3.03	1,166,774.22
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.73	1,226,220.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.26	1,056,480.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	9.70	1,605,805.90
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.19	737,440.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	9.09	4,709,074.50
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	4.17	1,045,727.58
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	5.85	1,883,700.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	131.80	2,306,500.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	5.60	797,367.20
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.20	1,612,000.00
BYD CO LTD-H	102,000	198.40	20,236,800.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	4.00	1,064,000.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	31.10	1,816,240.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	758,000	9.81	7,435,980.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	7.37	2,599,767.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	5.55	1,988,809.20
MINTH GROUP LTD	64,000	16.86	1,079,040.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	13.44	1,451,520.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	151,600	76.20	11,551,920.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	4.20	1,839,600.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	303,000	22.90	6,938,700.00
LI NING CO LTD	292,000	52.95	15,461,400.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	99,600	62.00	6,175,200.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	7.62	1,257,300.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	14.00	1,624,000.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	13.74	783,180.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	18.80	4,596,600.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	14.34	2,391,912.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.31	456,750.00
BAIDU INC-CLASS A	267,900	99.55	26,669,445.00
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	91.60	2,436,560.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	21.15	1,091,340.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	268,000	1.52	407,360.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	20.85	1,918,200.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	211,600	47.65	10,082,740.00
NETEASE INC	258,430	109.40	28,272,242.00
TENCENT HOLDINGS LTD	767,900	244.00	187,367,600.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,868,988	72.70	135,875,427.60
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	3.51	1,481,220.00

CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	11.44	1,189,760.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	123,550	44.50	5,497,975.00
JD.COM INC - CL A	264,511	168.40	44,543,652.40
MEITUAN-CLASS B	541,400	144.50	78,232,300.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	14.38	772,206.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	12.40	801,040.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	5.40	615,600.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	34.55	3,178,600.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	108.08	1,642,816.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.93	2,780,520.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	402,000	29.55	11,879,100.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	182,000	48.35	8,799,700.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.23	794,580.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	227,600	42.20	9,604,720.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	8.53	1,663,350.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	12.98	2,959,440.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	88,000	68.00	5,984,000.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.15	492,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.14	2,878,400.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	14.52	696,960.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	31.85	2,786,875.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	16.02	400,500.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	35,200	42.10	1,481,920.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	4.33	536,920.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	16.44	1,085,040.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	12.02	4,798,384.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	11.08	1,422,672.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	16.46	3,147,152.00
3SBIO INC	119,000	6.07	722,330.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	46.10	461,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	9.37	2,314,390.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,144,160	8.14	9,313,462.40
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.25	1,579,500.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	18.14	2,394,480.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	59.25	302,175.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	13.42	1,637,240.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	139,000	28.40	3,947,600.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	34.25	1,145,662.50
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	19.32	1,410,360.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	4.09	4,552,170.00
WUXI APPTec CO LTD-H	42,288	67.85	2,869,240.80

WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	446,000	47.20	21,051,200.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,441,000	2.34	8,051,940.00
BANK OF CHINA LTD-H	9,806,200	2.60	25,496,120.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.09	4,492,762.75
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.13	2,977,256.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	11,581,620	4.45	51,538,209.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.17	813,750.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	494,923	31.40	15,540,582.20
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.33	1,571,352.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,699,515	3.67	24,587,220.05
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	4.01	4,246,590.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.80	665,600.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	3.31	1,598,730.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	203,600	11.56	2,353,616.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	12.80	3,657,920.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.31	1,274,400.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	8.81	780,566.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	4.09	1,460,948.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	8.90	1,206,840.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	918,000	9.72	8,922,960.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	14.02	5,420,132.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	6.09	1,120,706.16
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	14.66	1,413,224.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.33	2,187,870.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	889,288	8.35	7,425,554.80
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	784,500	37.35	29,301,075.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	17.86	816,202.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	104,500	5.30	553,850.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	1.31	757,180.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	468,540	20.15	9,441,081.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	6.40	1,440,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	367,111	31.20	11,453,863.20
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	67,600	30.00	2,028,000.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	13.20	2,354,880.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	586,560	0.56	328,473.60
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,016,654	1.38	1,402,982.52
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	232,000	9.58	2,222,560.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	14.00	1,015,000.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	4.25	765,000.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	72,600	6.19	449,394.00
LONGFOR PROPERTIES	229,000	18.80	4,305,200.00
SEAZEN GROUP LTD	768,000	1.61	1,236,480.00

	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00	
	WHARF HOLDINGS	154,000	25.65	3,950,100.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	9.90	1,144,440.00	
	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	5.28	1,457,280.00	
	GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	14.90	1,887,830.00	
	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	10.30	3,203,300.00	
	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	88,000	4.40	387,200.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	12.42	981,180.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	12.48	892,320.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	19.14	1,157,970.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	23.05	1,544,350.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.24	499,560.00	
	LENOVO GROUP LTD	900,000	5.67	5,103,000.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	92,900	74.65	6,934,985.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,906,200	8.94	17,041,428.00	
	ZTE CORP-H	82,908	14.44	1,197,191.52	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	0.82	3,744,120.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	23.05	1,371,475.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.88	1,146,800.00	
	CGN POWER CO LTD-H	791,000	1.79	1,415,890.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	8.57	3,997,048.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	10.50	4,746,000.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	3.10	2,064,600.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	22.85	2,422,100.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	13.80	3,552,120.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	98,600	96.65	9,529,690.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	6.50	2,899,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	3.80	2,675,200.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	5.52	3,024,960.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	18.26	1,168,640.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	16.68	1,501,200.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	625,987	7.77	4,863,918.99	
	香港ドル 小計	101,300,689		1,195,769,928.67 (22,851,163,336)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	1.71	707,372.28	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	20.80	522,080.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	8.63	2,329,237.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	480,200	4.36	2,093,672.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	5.92	226,144.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.21	743,324.66	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	5.73	610,783.62	

MISC BHD	125,040	7.06	882,782.40
GENTING BHD	271,600	4.30	1,167,880.00
GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.60	961,220.00
MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.97	597,796.50
IOI CORPORATION BHD	270,340	3.83	1,035,402.20
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	50,646	21.20	1,073,695.20
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	132.70	955,440.00
PPB GROUP BERHAD	73,480	16.52	1,213,889.60
QL RESOURCES BHD	124,800	5.06	631,488.00
SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.25	1,049,945.50
HARTELEGA HOLDINGS BHD	181,300	1.84	333,592.00
IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.10	1,398,730.00
TOP GLOVE CORP BHD	504,900	0.72	366,052.50
AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.94	1,184,758.00
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	923,175	5.39	4,975,913.25
HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	20.86	1,278,551.12
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	18.80	312,700.40
MALAYAN BANKING BHD	571,105	8.55	4,882,947.75
PUBLIC BANK BERHAD	1,870,400	4.34	8,117,536.00
RHB BANK BHD	214,897	5.60	1,203,423.20
AXIATA GROUP BERHAD	285,289	2.57	733,192.73
DIGI.COM BERHAD	311,700	3.38	1,053,546.00
MAXIS BHD	267,900	3.38	905,502.00
TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.40	1,466,380.80
PETRONAS GAS BHD	75,500	17.00	1,283,500.00
TENAGA NATIONAL BHD	305,275	8.14	2,484,938.50
INARI AMERTRON BHD	274,700	2.37	651,039.00
マレーシアリングット 小計	10,178,928		49,434,456.21 (1,568,347,670)
タイバーツ			
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	168.50	33,834,800.00
PTT PCL-NVDR	1,393,600	34.25	47,730,800.00
THAI OIL PCL-NVDR	130,305	52.50	6,841,012.50
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	40.25	8,307,600.00
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	42.00	20,417,628.00
SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	52.00	5,231,200.00
SIAM CEMENT PCL-NVDR	102,600	320.00	32,832,000.00
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	8.20	6,637,900.00
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	5.75	4,659,225.00
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	26.50	9,612,557.00
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	39.75	7,242,450.00

	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	13.90	11,677,876.50	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	25.50	7,369,500.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	32.50	5,772,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	691,700	58.50	40,464,450.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	87.50	4,051,250.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	24.90	13,854,360.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	25.25	7,400,775.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	18.60	3,439,140.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	28.00	32,953,200.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	228.00	18,855,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	83,200	148.00	12,313,600.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	17.00	7,457,050.00	
	SCB X PCL-NVDR	88,700	106.50	9,446,550.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	15.20	2,509,520.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	72,600	65.25	4,737,150.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	56.75	5,760,125.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	35.50	3,187,900.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	40.50	3,090,150.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	65.75	14,879,225.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.90	7,760,800.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	670.00	26,063,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	185.50	22,204,350.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	69.50	8,468,575.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	5.15	4,951,256.35	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	32.50	1,735,500.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	163.50	2,763,150.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	93.00	20,450,700.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	60.00	4,092,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	50.00	20,145,000.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	81,450	39.25	3,196,912.50	
	タイパーツ 小計	14,766,671		559,653,987.85 (2,182,650,552)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	59.00	14,038,460.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	653.00	18,466,840.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	410.00	2,811,780.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	44.45	13,491,152.85	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	799.00	28,991,715.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	173.40	26,552,742.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	235.00	14,337,350.00	
	MONDE NISSIN CORP	490,500	11.58	5,679,990.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	111.30	10,635,828.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	92.00	19,551,380.00	

	BDO UNIBANK INC	219,911	123.00	27,049,053.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	51.00	8,225,637.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.61	8,504,077.00	
	AYALA LAND INC	794,100	25.80	20,487,780.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,567,750	33.70	52,833,175.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	320,000	12.50	4,000,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	5,044	2,400.00	12,105,600.00	
	PLDT INC	10,460	1,590.00	16,631,400.00	
	ACEN CORP	821,840	6.15	5,054,316.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	296.00	15,741,280.00	
	フィリピンペソ 小計	7,934,863		325,189,555.85 (827,054,597)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	3,840.00	8,303,232,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	31,800.00	6,388,620,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	964,000	1,760.00	1,696,640,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,825.00	1,799,085,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	795.00	2,291,587,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,775.00	2,142,855,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	3,680.00	5,973,732,960.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	6,900.00	2,098,980,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	7,750.00	2,678,400,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,542,000	6,525.00	16,586,550,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,590.00	5,539,233,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	5,500.00	4,357,650,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	22,750.00	1,355,900,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	9,125.00	1,469,125,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,225.00	2,671,147,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	5,350.00	3,993,240,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,980.00	8,293,230,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	6,769,300	8,275.00	56,015,957,500.00	
	BANK JAGO TBK PT	474,900	5,525.00	2,623,822,500.00	
	BANK MANDIRI	2,513,096	9,475.00	23,811,584,600.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,775.00	7,109,505,000.00	
PT BANK RAKYAT INDONESIA	8,237,202	4,300.00	35,419,968,600.00		
SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,120.00	3,181,472,000.00		
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	6,241,700	4,200.00	26,215,140,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	2,590.00	2,787,099,000.00		
	インドネシアルピア 小計	49,733,495		234,803,757,160.00 (2,277,596,444)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	58,800.00	304,584,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	84,900.00	542,256,300.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,766	163,500.00	1,106,241,000.00	

HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	52,000.00	643,812,000.00
HYUNDAI STEEL CO	11,189	30,750.00	344,061,750.00
KOREA ZINC CO LTD	1,204	618,000.00	744,072,000.00
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	135,500.00	257,179,000.00
LG CHEM LTD	6,193	593,000.00	3,672,449,000.00
LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	282,000.00	247,314,000.00
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	160,000.00	308,800,000.00
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	189,500.00	634,825,000.00
POSCO HOLDINGS INC	9,290	255,000.00	2,368,950,000.00
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,122	90,200.00	101,204,400.00
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	51,100.00	119,471,800.00
SKC CO LTD	1,734	100,000.00	173,400,000.00
CJ CORP	1,230	71,700.00	88,191,000.00
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	30,600.00	131,824,800.00
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	55,063	13,350.00	735,091,050.00
ECOPRO BM CO LTD	4,680	106,200.00	497,016,000.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	23,100.00	156,156,000.00
GS HOLDINGS CORP	6,593	46,850.00	308,882,050.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	35,700.00	348,717,600.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	111,500.00	235,822,500.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,828	42,750.00	249,147,000.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	73,000.00	317,842,000.00
LG CORP	11,686	79,800.00	932,542,800.00
LG ENERGY SOLUTION	3,158	497,500.00	1,571,105,000.00
SAMSUNG C&T CORP	11,910	108,500.00	1,292,235,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	23,600.00	436,977,600.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	5,140.00	489,168,660.00
SK INC	4,545	204,500.00	929,452,500.00
S-1 CORPORATION	3,573	57,700.00	206,162,100.00
CJ LOGISTICS	862	83,200.00	71,718,400.00
HMM CO LTD	35,545	19,300.00	686,018,500.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	170,000.00	474,810,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	23,739	23,200.00	550,744,800.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,630.00	137,677,680.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	36,350.00	256,849,100.00
HANON SYSTEMS	19,000	7,640.00	145,160,000.00
HYUNDAI MOBIS	7,116	207,500.00	1,476,570,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	16,824	168,000.00	2,826,432,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	79,000.00	477,318,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	79,100.00	272,815,900.00
KIA CORP	32,718	69,000.00	2,257,542,000.00
COWAY CO LTD	9,036	53,200.00	480,715,200.00

F&F CO LTD / NEW	3,017	138,000.00	416,346,000.00
HLB INC	10,012	39,400.00	394,472,800.00
LG ELECTRONICS INC	13,527	80,600.00	1,090,276,200.00
KANGWON LAND INC	7,703	23,300.00	179,479,900.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	9,880	23,650.00	233,662,000.00
CJ ENM CO LTD	830	78,800.00	65,404,000.00
HYBE CO LTD	2,474	118,500.00	293,169,000.00
KAKAO CORP	37,877	49,800.00	1,886,274,600.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	38,200.00	115,402,200.00
KRAFTON INC	3,554	183,000.00	650,382,000.00
NAVER CORP	15,839	168,500.00	2,668,871,500.00
NCSOFT CORPORATION	1,939	362,500.00	702,887,500.00
NETMARBLE CORP	2,465	45,950.00	113,266,750.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	41,350.00	190,416,750.00
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	73,500.00	320,680,500.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	90,000.00	93,060,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	175,000.00	285,600,000.00
EMART	3,594	86,200.00	309,802,800.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	403,000.00	312,325,000.00
KT&G CORP	18,829	88,000.00	1,656,952,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	98,900.00	310,743,800.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	98,100.00	369,052,200.00
LG H&H CO LTD	956	578,000.00	552,568,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	389	293,500.00	114,171,500.00
PACIFIC CORP	3,393	25,050.00	84,994,650.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,851	65,000.00	575,315,000.00
SD BIOSENSOR INC	3,909	28,150.00	110,038,350.00
ALTEOGEN INC	2,841	41,550.00	118,043,550.00
CELLTRION INC	12,283	171,500.00	2,106,534,500.00
CELLTRION PHARM INC	1,968	63,700.00	125,361,600.00
GREEN CROSS CORP	564	121,500.00	68,526,000.00
HANMI PHARM CO LTD	1,156	240,500.00	278,018,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,993	847,000.00	1,688,071,000.00
SEEGENE INC	3,838	29,400.00	112,837,200.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	55,500.00	177,433,500.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	74,900.00	157,290,000.00
YUHAN CORPORATION	12,567	55,500.00	697,468,500.00
HANA FINANCIAL GROUP	41,045	39,500.00	1,621,277,500.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,350.00	293,215,500.00
KAKAObANK CORP	18,421	17,400.00	320,525,400.00
KB FINANCIAL GROUP INC	48,657	47,900.00	2,330,670,300.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	59,426	37,050.00	2,201,733,300.00

	WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	12,000.00	712,872,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	51,100.00	235,162,200.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	7,939	23,400.00	185,772,600.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	3,650.00	174,849,600.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,330.00	196,324,950.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,080.00	109,931,560.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	31,900.00	184,254,400.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	58,900.00	247,910,100.00	
	MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	7,329	31,250.00	229,031,250.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	196,500.00	610,722,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	65,800.00	798,219,800.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	118,500.00	441,412,500.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	2,166	59,800.00	129,526,800.00	
	L&F CO LTD	3,026	217,100.00	656,944,600.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	14,250.00	343,011,750.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	279,000.00	394,785,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,845	117,000.00	800,865,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	586,345	55,800.00	32,718,051,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	103,443	51,700.00	5,348,003,100.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,526	606,000.00	3,954,756,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	10,900.00	241,162,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	17,050.00	451,125,950.00	
	SK HYNIX INC	65,667	92,900.00	6,100,464,300.00	
	SK SQUARE CO LTD	11,660	38,750.00	451,825,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,983,778		112,718,930,300.00 (11,801,672,002)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	77.90	8,743,496.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	37.95	8,886,979.20	
	CHINA STEEL	1,494,261	27.45	41,017,464.45	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	68.10	28,606,154.10	
	FORMOSA PLASTICS CORP	504,824	80.20	40,486,884.80	
	NAN YA PLASTICS CORP	647,752	66.10	42,816,407.20	
	TAIWAN CEMENT	648,419	31.60	20,490,040.40	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	731.00	13,565,167.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	31.00	10,788,868.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,340.00	12,060,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	309,213	35.50	10,977,061.50	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	17.05	7,928,250.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	24.10	9,302,600.00	
	EVERGREEN MARINE	123,215	144.00	17,742,960.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	27.55	13,003,600.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	67.90	5,067,716.50	

YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	63.00	13,671,000.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	33.50	5,931,543.50
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	419.00	8,353,603.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	161.00	11,342,128.00
GIANT MANUFACTURING	34,464	210.50	7,254,672.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	253.00	7,843,000.00
POU CHEN	273,780	27.95	7,652,151.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	42,000	577.00	24,234,000.00
MOMO.COM INC	6,000	502.00	3,012,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	271.00	23,995,424.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	645,395	65.30	42,144,293.50
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	593,540	16.35	9,704,379.00
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,258,237	19.90	44,938,916.30
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,491,629	22.50	33,561,652.50
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,273,202	23.75	30,238,547.50
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,095,361	20.30	22,235,828.30
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,241,622	29.00	36,007,038.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,168,457	16.50	19,279,540.50
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,348,011	12.90	17,389,341.90
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,110,787	24.05	26,714,427.35
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	451,861	46.70	21,101,908.70
CHAILEASE HOLDING CO LTD	151,375	172.00	26,036,500.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,389,633	19.00	26,403,027.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,016,123	38.30	38,917,510.90
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,896,226	11.20	21,237,731.20
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	954,906	50.40	48,127,262.40
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	7.93	15,319,697.38
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	206,724	58.80	12,155,371.20
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70,000	241.50	16,905,000.00
ACER INC	255,803	22.10	5,653,246.30
ADVANTECH CO LTD	43,336	297.50	12,892,460.00
ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	239.00	17,229,988.00
AUO CORP	756,072	18.15	13,722,706.80
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	170.50	20,238,350.00
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,390,080	13.20	18,349,056.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	21.05	9,088,548.00
DELTA ELECTRONICS INC	239,903	268.00	64,294,004.00
E INK HOLDINGS INC	94,000	201.00	18,894,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,510,248	103.00	155,555,544.00
INVENTEC CO LTD	280,511	22.65	6,353,574.15
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	1,780.00	26,771,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	65.00	14,654,380.00

	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	110.00	6,600,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	205.00	4,305,000.00	
	PEGATRON CORP	200,474	56.70	11,366,875.80	
	QUANTA COMPUTER INC	286,270	70.60	20,210,662.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	54.40	10,994,240.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	141,000	122.50	17,272,500.00	
	WIWYNN CORP	8,000	672.00	5,376,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	260,692	45.70	11,913,624.40	
	YAGEO CORPORATION	54,764	268.00	14,676,752.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	107.00	14,757,654.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	505,315	107.50	54,321,362.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	67.90	14,666,400.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	91.00	22,313,200.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	427,315	74.90	32,005,893.50	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	616.00	1,848,000.00	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,030.00	6,180,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	342.50	8,220,000.00	
	MEDIATEK INC	188,804	577.00	108,939,908.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	53.80	6,187,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	74,045	244.00	18,066,980.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	688.00	5,504,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	301,000	29.90	8,999,900.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	251.50	15,578,916.00	
	SILERGY CORP	36,000	419.00	15,084,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,027,389	395.50	1,197,332,349.50	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,411,000	38.20	53,900,200.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	62.70	5,580,300.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	127.00	4,064,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	20.25	7,067,250.00	
	新台湾ドル 小計	41,447,801		3,000,221,169.23 (14,050,635,779)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	292.20	28,115,776.20	
	COAL INDIA LTD	180,326	238.10	42,935,620.60	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	202.40	12,027,620.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	290,647	67.00	19,473,349.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	381,562	127.70	48,725,467.40	
	PETRONET LNG LTD	83,779	201.85	16,910,791.15	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	375,247	2,496.50	936,804,135.50	
	ACC LTD	5,315	2,245.95	11,937,224.25	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	510.55	37,542,273.15	
	ASIAN PAINTS LTD	46,971	3,214.10	150,969,491.10	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	618.60	18,217,151.40	

GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,685.35	53,137,400.15
HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	390.40	70,467,590.40
JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	439.50	30,665,673.00
JSW STEEL LTD	99,332	625.85	62,166,932.20
PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,169.65	40,562,011.05
PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,665.45	48,508,524.55
SHREE CEMENT LTD	1,387	21,330.00	29,584,710.00
SRF LTD	14,609	2,580.85	37,703,637.65
TATA STEEL LTD	940,850	100.05	94,132,042.50
ULTRATECH CEMENT LTD	11,556	6,397.55	73,930,087.80
UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	676.65	47,129,349.15
VEDANTA LTD	107,173	277.30	29,719,072.90
ADANI ENTERPRISES LTD	34,272	3,277.00	112,309,344.00
BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	105.85	53,708,819.25
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,248.35	44,523,651.10
LARSEN & TOUBRO LTD	82,638	1,904.90	157,417,126.20
SIEMENS INDIA LTD	11,025	2,884.85	31,805,471.25
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	742.65	17,075,751.45
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	64,743	804.90	52,111,640.70
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	771.15	20,400,773.25
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,781.10	14,889,996.00
BAJAJ AUTO LTD	9,644	3,654.50	35,243,998.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	1,914.70	16,908,715.70
BHARAT FORGE LTD	30,322	781.05	23,682,998.10
EICHER MOTORS LTD	14,685	3,611.10	53,029,003.50
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,541.25	31,099,817.50
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	101,669	1,248.60	126,943,913.40
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	15,707	8,721.85	136,994,097.95
MRF LTD	432	83,167.30	35,928,273.60
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	186,639	63.50	11,851,576.50
TATA MOTORS LTD	190,082	399.05	75,852,222.10
PAGE INDUSTRIES LTD	886	52,881.20	46,852,743.20
TITAN CO LTD	46,501	2,644.40	122,967,244.40
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	605.15	26,584,239.50
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	3,863.55	30,348,185.25
TRENT LTD	19,255	1,424.60	27,430,673.00
ZOMATO LTD	427,818	62.10	26,567,497.80
AVENUE SUPERMARTS LTD	21,281	4,166.80	88,673,670.80
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,474	3,766.80	43,220,263.20
ITC LTD	345,135	346.35	119,537,507.25
MARICO LTD	81,711	517.40	42,277,271.40
NESTLE INDIA LIMITED	3,906	19,754.65	77,161,662.90

TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	764.35	46,635,286.55
UNITED SPIRITS LTD	32,483	828.90	26,925,158.70
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,577.55	15,090,843.30
DABUR INDIA LTD	58,111	526.15	30,575,102.65
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	826.65	52,406,303.40
HINDUSTAN UNILEVER LTD	104,076	2,582.60	268,786,677.60
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	13,485	4,389.90	59,197,801.50
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	522.10	18,490,171.50
BIOCON LTD	58,256	269.50	15,699,992.00
CIPLA LTD	49,816	1,122.10	55,898,533.60
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	3,610.15	53,365,237.30
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,316.65	54,579,722.60
LUPIN LTD	26,552	688.10	18,270,431.20
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	110,469	976.55	107,878,501.95
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,577.85	19,281,327.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	626.45	18,877,444.30
AXIS BANK LTD	273,120	829.65	226,594,008.00
BANDHAN BANK LTD	74,811	268.60	20,094,234.60
ICICI BANK LTD	637,362	891.70	568,335,695.40
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	73,561	1,869.35	137,511,255.35
STATE BANK OF INDIA	226,932	553.20	125,538,782.40
YES BANK LTD	1,020,164	15.95	16,271,615.80
BAJAJ FINANCE LTD	34,450	7,378.40	254,185,880.00
BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,698.90	93,439,500.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	746.50	28,772,349.50
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	214,032	2,381.35	509,685,103.20
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,049.70	13,040,423.10
PIRAMAL PHARMA LTD	46,888	191.75	8,990,774.00
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	885.95	27,475,967.35
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,214.95	25,776,379.20
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	129,053	530.95	68,520,690.35
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,137.00	26,764,980.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	508.25	16,127,789.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,225.95	65,919,331.50
DLF LTD	56,420	370.20	20,886,684.00
GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,216.30	15,476,201.20
HCL TECHNOLOGIES LTD	139,804	995.40	139,160,901.60
INFOSYS LTD	411,657	1,485.00	611,310,645.00
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	4,694.50	27,021,542.00
MINDTREE LTD	6,247	3,404.50	21,267,911.50
MPHASIS LTD	7,796	2,110.30	16,451,898.80
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	111,824	3,120.75	348,974,748.00

	TATA ELXSI LTD	4,179	7,316.45	30,575,444.55	
	TECH MAHINDRA LTD	72,109	1,019.20	73,493,492.80	
	WIPRO LTD	179,580	378.00	67,881,240.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	294,891	783.35	231,002,864.85	
	INDUS TOWERS LTD	90,578	191.10	17,309,455.80	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	2,119.35	90,241,923.00	
	ADANI POWER LTD	85,623	334.00	28,598,082.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	33,068	3,160.25	104,503,147.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	32,827	3,140.20	103,083,345.40	
	GAIL INDIA LTD	262,152	84.75	22,217,382.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	376.30	10,056,241.20	
	NTPC LTD	664,141	164.00	108,919,124.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	327,337	213.85	70,001,017.45	
	TATA POWER CO LTD	199,512	218.45	43,583,396.40	
	インドルピー 小計	12,310,948		8,941,784,061.80	(16,274,046,992)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	19.05	1,141,361.70	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.14	1,948,909.77	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.37	1,054,321.87	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	16.80	3,306,038.40	
	COMMERCIAL BANK QSC	326,034	7.09	2,314,189.33	
	MASRAF AL RAYAN	732,376	4.00	2,930,968.75	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	11.37	1,120,615.83	
	QATAR ISLAMIC BANK	185,298	24.00	4,447,152.00	
	QATAR NATIONAL BANK	563,501	19.60	11,044,619.60	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.41	708,993.33	
	OOREDOO QSC	72,800	9.20	669,760.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	17.65	1,703,436.80	
	カタールリアル 小計	3,452,927		32,390,367.38	(1,322,174,796)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	204.40	4,603,088.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	258.52	3,792,488.40	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	5,906	1,411.80	8,338,090.80	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	51,324	228.06	11,704,951.44	
	GOLD FIELDS LTD	120,051	137.50	16,507,012.50	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	47.76	2,688,935.76	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	114,090	171.70	19,589,253.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	378.90	2,035,450.80	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	32,710	167.45	5,477,289.50	
	SASOL LTD	72,299	314.99	22,773,462.01	
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	41.85	16,527,569.40	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	205.64	5,696,639.28	

	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	117.34	4,755,672.86	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	180.10	5,134,651.00	
	NASPERS LTD-N SHS	27,673	2,120.65	58,684,747.45	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	144,533	21.24	3,069,880.92	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	117.90	4,427,616.60	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	62.00	6,850,690.00	
	BID CORP LTD	35,017	286.00	10,014,862.00	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	277.24	9,820,395.28	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	60,003	226.20	13,572,678.60	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	152.67	3,553,241.58	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	150.10	8,432,918.20	
	ABSA GROUP LTD	95,814	193.08	18,499,767.12	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	11,355	1,845.65	20,957,355.75	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	208.56	13,162,430.16	
	STANDARD BANK GROUP LTD	173,745	163.93	28,482,017.85	
	FIRSTSTRAND LTD	617,542	62.64	38,682,830.88	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	281.43	4,836,937.41	
	REMGRO LTD	55,441	135.90	7,534,431.90	
	DISCOVERY LIMITED	59,544	114.89	6,841,010.16	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	10.11	4,949,977.32	
	SANLAM LTD	214,053	51.99	11,128,615.47	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	60,556	87.42	5,293,805.52	
	MTN GROUP LTD	219,239	124.05	27,196,597.95	
	VODACOM GROUP	62,331	124.00	7,729,044.00	
	南アフリカランド 小計	3,656,591		443,346,406.87 (3,626,573,608)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	4.23	1,878,213.06	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	9.23	3,018,560.74	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	9.26	1,720,332.06	
	DUBAI ISLAMIC BANK	335,455	6.09	2,042,920.95	
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	12.95	3,499,867.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	529,392	17.80	9,423,177.60	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	487,034	4.35	2,118,597.90	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	576,832	6.17	3,559,053.44	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	404,510	23.60	9,546,436.00	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	3,560,324		36,807,158.75 (1,505,412,792)	
クウェートディ ナール	AGILITY	157,695	0.73	115,748.13	
	BOUBYAN BANK K.S.C	152,875	0.80	122,911.50	
	GULF BANK	137,143	0.33	45,942.90	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	932,130	0.79	740,111.22	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	838,738	1.03	868,093.83	

	MABANEE CO KPSC	133,798	0.86	115,333.87	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.58	173,942.38	
	クウェートディナール 小計	2,649,209		2,182,083.83 (1,057,066,869)	
オフショア人民 元	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	31.04	620,800.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	5.11	511,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	21.68	2,085,616.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	13.45	1,070,620.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	15.06	1,322,268.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	32.60	912,800.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	20,700	46.62	965,034.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	4.13	678,559.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	28.02	824,908.80	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	5.25	203,175.00	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	48.37	996,422.00	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	12,447	18.42	229,273.74	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	12.99	1,197,678.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	26.65	554,320.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	78.74	881,888.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	48.20	1,196,613.20	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	15.90	589,890.00	
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	2,400	113.32	271,968.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	15.21	152,100.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.86	857,460.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	3.99	239,400.00	
	JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	15.50	345,650.00	
	JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	101.91	794,898.00	
	KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	10.45	317,680.00	
	LB GROUP CO LTD-A	15,300	16.49	252,297.00	
	NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	21.35	1,005,585.00	
	NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	12.90	1,021,680.00	
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	5.36	104,520.00	
	QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	23.59	1,122,884.00	
	RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	11.45	554,752.50	
	SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	13.92	772,212.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	16.91	122,631.32	
	SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	28.80	516,672.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.18	911,388.00		
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	11,200	58.18	651,616.00		
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	4.52	621,048.00		
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	15.42	760,206.00		
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	44.71	482,868.00		

SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	600	292.86	175,716.00
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A	16,100	68.29	1,099,469.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	98.78	1,126,092.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	13.27	130,046.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	2.65	878,740.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	5.52	508,944.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	85.51	1,496,425.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	78.06	719,713.20
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	11,775	116.83	1,375,673.25
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	12.85	1,430,205.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,400	127.80	178,920.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	172.70	708,070.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	60.05	444,970.50
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	105,600	7.92	836,352.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	46.04	524,856.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	40.80	632,400.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	23.40	196,560.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	12.54	802,560.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	24.93	1,376,509.95
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.25	1,356,975.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.13	1,081,917.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	17,700	431.34	7,634,718.00
CRRG CORP LTD-A	185,800	4.71	875,118.00
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	96.22	728,674.06
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	6.32	144,096.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	206.42	495,408.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	34.30	198,940.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	88.88	559,944.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	35.69	939,360.80
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	49.35	565,353.60
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	17.42	837,902.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.02	999,318.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	27.80	1,006,360.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	69,984	25.50	1,784,592.00
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	3,300	389.10	1,284,030.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	75.69	883,680.75
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	19.86	802,344.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	7.51	1,225,632.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	14.63	612,997.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	65.29	1,853,778.97
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	17,900	10.94	195,826.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	132.30	1,323,000.00

SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	26.14	1,063,898.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	500.90	1,282,304.00
TBEA CO LTD-A	22,519	22.22	500,372.18
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	9.70	419,040.00
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	5,320	138.64	737,564.80
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	4.50	897,300.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	12.06	242,538.66
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	28.20	891,120.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	38.82	320,653.20
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	9.39	846,978.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	5.66	453,366.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	42,581	4.74	201,833.94
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	43.31	476,410.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	10.11	261,849.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	338,800	4.52	1,531,376.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.94	197,600.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	6.91	1,109,055.00
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	51.22	1,039,766.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	56.67	301,427.73
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.54	245,976.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	21.85	1,217,045.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	15.83	345,727.20
BYD CO LTD -A	9,700	267.50	2,594,750.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	153.01	1,377,090.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	12.51	542,333.52
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	36.61	677,285.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	16.06	550,858.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	131.68	1,106,112.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	16.10	471,730.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	73.41	51,387.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.39	613,014.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	18.03	707,749.62
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	1,443	246.81	356,146.83
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	67.28	188,384.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	31.13	1,354,155.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	22.49	624,322.40
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	34.60	274,447.20
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	108.69	836,913.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	23.51	611,260.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	4.25	433,500.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	44.80	358,400.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	54.80	1,435,760.00

SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	4.69	371,917.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	11.29	377,989.20
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	14.91	365,295.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	7.00	375,200.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.48	763,912.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	245.15	710,935.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	24.97	407,011.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	12.53	285,684.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	3.86	237,390.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	179.60	2,191,120.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	6.59	728,195.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	18,576	35.21	654,060.96
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	54.67	554,353.80
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	40.52	433,564.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	218.00	348,800.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	43.87	96,514.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	54.51	997,533.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	147.80	443,400.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	8.84	525,980.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	20.93	215,579.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	41.43	414,300.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	94.65	747,735.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	25.17	115,782.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	20,248	71.03	1,438,215.44
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	21.96	601,704.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	60.83	1,034,110.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	24.54	29,448.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	32.50	1,114,815.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	42.24	730,752.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	141.13	1,284,283.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	4.85	134,345.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	120.00	672,000.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	32.02	368,230.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	50.41	352,870.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	9,200	1,648.00	15,161,600.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	196.62	1,926,876.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	56.60	1,899,382.80
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	14.29	382,972.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	262.60	2,463,188.00
TONGWEI CO LTD-A	31,600	48.93	1,546,188.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	20.90	797,544.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	30,200	154.50	4,665,900.00

YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	42.65	430,765.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	14.58	77,274.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	17.54	520,938.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	70,574	29.96	2,114,397.04
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	74.65	211,856.70
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	44.94	436,816.80
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	9,450	21.80	206,010.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	52.47	648,004.50
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	11.95	124,280.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	25.03	370,444.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	4.33	107,557.20
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	44.96	324,116.64
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	328.01	2,755,284.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	134.24	268,480.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	8.06	304,909.80
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	148.37	41,543.60
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	28,080	22.03	618,602.40
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	50.83	1,443,572.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	7,491	121.01	906,485.91
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	53.37	859,257.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	57.36	315,480.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	194.73	428,406.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	46.00	469,200.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	94.24	932,976.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	33.68	747,460.24
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	27.17	434,720.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	89.00	712,000.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	19.75	372,287.50
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	462.30	961,584.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	39.00	1,485,978.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	11,116	62.11	690,414.76
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	17.53	485,265.46
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	5.50	352,550.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	32.14	349,683.20
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	30.87	216,090.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	23.25	219,480.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	25.51	286,528.32
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	39.72	675,240.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	80.15	1,319,589.60
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	54.35	540,239.00
ZHANGZHOU PIENZTEHUANG PHA-A	3,900	262.10	1,022,190.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	20.23	182,474.60

ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	20.02	697,656.96
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	48.40	469,480.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	2.84	1,004,224.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.10	237,800.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.59	453,951.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	14.02	1,580,054.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.34	1,686,291.60
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	10.43	1,538,425.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	28.49	1,660,967.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	5.90	268,450.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	5.49	685,701.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	2.80	360,920.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	137,700	30.26	4,166,802.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.40	930,240.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	2.93	904,198.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.04	601,776.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	4.34	2,511,124.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	16.15	1,537,480.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	11.29	1,348,026.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.12	582,980.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	6.97	963,951.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.11	380,975.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	10.73	851,962.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	6.99	400,736.70
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.40	107,460.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.39	391,813.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	12.55	359,683.00
CITIC SECURITIES CO-A	49,680	18.10	899,208.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	23.86	575,026.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	97,856	17.74	1,735,965.44
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	13.68	49,248.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.56	334,712.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	6.51	539,028.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	14.73	892,638.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	171,679	5.77	990,587.83
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	13.77	995,571.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.69	1,017,214.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	78.37	423,198.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	12.28	386,820.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	5.54	633,055.80
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	7.94	339,038.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	7.83	317,710.08

SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	3.92	812,224.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.89	443,460.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	9.99	436,563.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	20.15	366,730.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	41.27	2,756,836.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	15.44	844,568.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	16.17	868,329.00
GEMDALE CORP-A	45,500	9.93	451,815.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	566,400	2.10	1,189,440.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	16.87	1,379,966.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	15.66	200,448.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	10.64	90,440.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	6.91	185,879.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	245.00	1,181,635.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	26,460	12.05	318,843.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	8.57	246,816.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	5.73	319,161.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	34.43	570,229.66
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	32.70	353,160.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	12.07	400,724.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	102.92	308,760.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	7,943	38.39	304,931.77
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	108.31	595,705.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	19.03	250,625.10
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	26.77	1,014,583.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.59	411,414.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	28.40	795,200.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	9.50	330,600.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	120.88	1,100,008.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	13.52	281,216.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	8.40	378,840.00
GOERTEK INC -A	26,900	25.50	685,950.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	4.61	230,500.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	68.62	480,340.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	20.65	407,052.80
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	9.58	160,944.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	29.19	1,355,875.50
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	84.61	146,206.08
NINESTAR CORP-A	18,543	52.03	964,792.29
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	5.37	168,081.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	13.59	330,237.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	75.55	359,618.00

SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	61.09	393,114.15
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	25.44	725,040.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	8.84	415,480.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	16.45	301,693.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	20,100	31.09	624,909.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	47.50	199,500.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	41,316	11.72	484,223.52
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	169.00	794,300.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	65.49	736,762.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	12.29	372,387.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	28.26	245,862.00
ZTE CORP-A	12,600	21.92	276,192.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	6.18	1,074,084.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	5.90	1,423,670.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	22.37	4,023,915.60
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	16.98	944,088.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	4.63	1,461,691.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	10.98	742,248.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	12.22	1,127,906.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	86.41	613,251.77
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	59.00	598,142.00
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	3.42	282,150.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	84.10	527,475.20
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	15,120	59.47	899,186.40
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	31.52	236,400.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	69.50	521,250.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	24,430	63.47	1,550,572.10
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	21.56	642,488.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	47,040	49.13	2,311,075.20
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	46.82	985,795.10
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	64,153	18.37	1,178,490.61
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	241.00	747,100.00
SG MICRO CORP-A	3,150	151.00	475,650.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	333.90	934,920.00
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	29,500	43.41	1,280,595.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	8.33	272,807.50
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	14.82	332,946.12
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	65.51	1,665,133.18
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	152.50	1,045,997.50
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	79.20	577,368.00
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	51.00	724,200.00
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	69.96	1,190,859.12

	オフショア人民元 小計	17,212,728		270,690,284.07 (5,586,830,910)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	14.42	648,020.38
	SAUDI ARABIAN OIL CO	288,739	35.75	10,322,419.25
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	45.70	538,117.50
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	13.86	442,522.08
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	28,237	170.00	4,800,290.00
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	42.95	2,029,000.95
	SAUDI ARABIAN MINING CO	106,575	75.80	8,078,385.00
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	113,559	92.20	10,470,139.80
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,414	23.06	885,826.84
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	13.98	1,445,965.38
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	47.35	1,257,426.60
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	200.00	841,400.00
	JARIR MARKETING CO	12,500	165.00	2,062,500.00
	ALMARAI CO	30,130	57.90	1,744,527.00
	SAVOLA	25,336	29.85	756,279.60
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	237.80	2,786,302.60
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	228.80	1,821,705.60
	AL RAJHI BANK	237,965	85.70	20,393,600.50
	ALINMA BANK	109,956	35.80	3,936,424.80
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	31.20	2,684,167.20
	BANK AL-JAZIRA	35,813	24.10	863,093.30
	BANK ALBILAD	61,145	51.50	3,148,967.50
	BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	43.75	2,954,700.00
	RIYAD BANK	166,012	33.80	5,611,205.60
	SAUDI BRITISH BANK	116,762	43.20	5,044,118.40
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	41,945	18.16	761,721.20
	THE SAUDI NATIONAL BANK	276,263	64.30	17,763,710.90
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	3,929	215.00	844,735.00
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	182.00	1,103,466.00
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	16.30	1,646,153.30
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.97	460,484.39	
ELM CO	2,436	323.00	786,828.00	
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	35.40	1,218,255.60	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	12.64	1,144,021.12	
SAUDI TELECOM CO	183,517	38.55	7,074,580.35	
ACWA POWER CO	9,184	170.60	1,566,790.40	
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	25.90	2,388,523.90	
	サウジアラビアリアル 小計	2,702,124		132,326,376.04 (5,290,408,514)
		1,077,295,362		104,477,588,279

合 計			(104,477,588,279)
-----	--	--	-------------------

(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	7,110,200.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	7,110,200.00 (53,000,141)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	3,603,100.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,413,261.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,718,530.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,319,778.00	
ブラジルリアル 小計	279,400	8,054,669.00 (229,037,734)			
投資信託受益証券合計			337,800	282,037,875 (282,037,875)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	8,660,487.00	
		メキシコペソ 小計	391,700	8,660,487.00 (64,556,136)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	6,319,275.60	
		南アフリカランド 小計	478,733	6,319,275.60 (51,691,674)	
投資証券合計			870,433	116,247,810 (116,247,810)	
合計				398,285,685 (398,285,685)	

(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 40銘柄	100.0%			2.9%
メキシコペソ	株式 21銘柄	95.2%			2.2%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.2%		0.1%

	投資証券 1銘柄			2.6%	0.1%
ブラジルリアル	株式 45銘柄	96.6%			6.1%
	投資信託受益証券 4銘柄		3.4%		0.2%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%			0.6%
コロンビアペソ	株式 4銘柄	100.0%			0.1%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 12銘柄	100.0%			0.5%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.0%			0.5%
ロシアルーブル	株式 14銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式 195銘柄	100.0%			21.8%
マレーシアリングギット	株式 34銘柄	100.0%			1.5%
タイバーツ	株式 43銘柄	100.0%			2.1%
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%			2.2%
韓国ウォン	株式 111銘柄	100.0%			11.3%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%			13.4%
インドルピー	株式 109銘柄	100.0%			15.5%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.0%			1.3%
南アフリカランド	株式 36銘柄	98.6%			3.5%
	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%			1.4%
クウェートディナール	株式 7銘柄	100.0%			1.0%
オフショア人民元	株式 332銘柄	100.0%			5.3%
サウジアラビアリアル	株式 37銘柄	100.0%			5.0%

(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。

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10月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	751,020,543
コール・ローン	234,662,352
国債証券	83,988,416,401
未収利息	1,334,747,383
前払費用	129,237,498
流動資産合計	86,438,084,177
資産合計	86,438,084,177
負債の部	
流動負債	
未払解約金	10,427,244
未払利息	454
流動負債合計	10,427,698
負債合計	10,427,698
純資産の部	
元本等	
元本	47,266,208,382
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	39,161,448,097
元本等合計	86,427,656,479
純資産合計	86,427,656,479
負債純資産合計	86,438,084,177

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年10月20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>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>

	2022年10月20日現在
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10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,266,208,382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 1.8285円 (1万口当たり純資産額) (18,285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10月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

	2022年10月20日現在
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 4月21日
期首元本額	46,958,531,099円
期中追加設定元本額	4,316,960,000円
期中一部解約元本額	4,009,282,717円
期末元本額	47,266,208,382円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	5,212,020,066円
世界経済インデックスファンド	13,450,429,503円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,218,096,737円
DC世界経済インデックスファンド	11,396,460,305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)	4,007,149円
コア投資戦略ファンド(安定型)	35,878,977円

区分	2022年10月20日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	181,683,363円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	45,961,202円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	493,631,197円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,630,164,619円
コア投資戦略ファンド（切替型）	68,544,373円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	209,541,789円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	93,417,121円
SMT インデックスバランス・オープン	169,623,984円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	1,942,180,440円
SMT 世界経済インデックス・オープン	367,457,007円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	461,254,010円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	731,689,567円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,139,205円
グローバル経済コア	748,594,036円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	19,402,087円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	3,565,644円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	34,004,093円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	26,848,810円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	9,859,403円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	11,703,437円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	5,391,172円
10資産分散投資ファンド	13,984円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	30,629,299円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	493,362,892円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	131,855,826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）	9,406,880円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	258,840,573円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	274,886,771円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	273,471,389円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	250,720,521円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	246,972,169円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	7,824,223,367
合計	7,824,223,367

(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	32,007,972.00		
		MBONO 10% 12/05/24	104,250,000.00	103,332,600.00		
		MBONO 5.5% 03/04/27	69,000,000.00	58,007,610.00		
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	153,529,493.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000.00	103,695,540.00		
		MBONO 7.75% 05/29/31	158,100,000.00	138,582,555.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	68,432,325.00		
		MBONO 7.75% 11/23/34	13,600,000.00	11,547,080.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	115,100,000.00	107,352,619.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	86,866,727.00		
		MBONO 8% 07/31/53	12,000,000.00	9,811,320.00		
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	122,940,432.00		
		MBONO 8% 11/07/47	100,600,000.00	82,926,592.00		
		MBONO 8% 12/07/23	88,000,000.00	85,454,160.00		
	メキシコペソ 小計			1,292,950,000.00	1,164,487,025.00 (8,680,202,733)	
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	104,100,000.00	90,137,275.20		
		BLTN 0% 01/01/26	24,500,000.00	17,192,257.60		
		BLTN 0% 07/01/23	53,300,000.00	48,824,297.72		
		BLTN 0% 07/01/24	30,850,000.00	25,421,658.68		
BLTN 0% 07/01/25		38,900,000.00	28,936,010.07			
BNTNF 10% 01/01/25		31,800,000.00	30,738,777.84			
BNTNF 10% 01/01/27		41,200,000.00	39,012,611.00			
BNTNF 10% 01/01/29		26,700,000.00	24,646,250.25			
BNTNF 10% 01/01/31		13,850,000.00	12,545,890.01			

	BNTNF 10% 01/01/33	1,500,000.00	1,336,334.45	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,300,250.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,783,625.00	
ブラジルリアル 小計		370,000,000.00	321,875,237.82 (9,152,651,137)	
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	805,000,000.00	633,070,305.70	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,675,138,600.46	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,920,000,000.00	1,775,863,495.68	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,050,000,000.00	1,820,749,342.55	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	1,948,286,652.91	
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	599,984,391.60	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,790,000,000.00	1,695,207,730.75	
チリペソ 小計		12,420,000,000.00	11,148,300,519.65 (1,714,419,098)	
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	56,851,486,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	12,000,000,000.00	9,764,640,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	40,100,000,000.00	24,222,405,000.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	25,400,000,000.00	13,012,420,000.00	
コロンビアペソ 小計		142,800,000,000.00	103,850,951,000.00 (3,216,160,101)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,117,915.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	4,806,569.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,605,391.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	9,500,000.00	8,401,325.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,800,000.00	6,544,512.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,350,000.00	7,673,650.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	8,250,000.00	6,939,900.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	8,350,000.00	7,556,165.50	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,550,000.00	6,820,318.50	
ペルーソル 小計		63,350,000.00	55,465,746.00 (2,087,187,115)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	20,749,750.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	15,008,110.00	
ウルグアイペソ 小計		42,000,000.00	35,757,860.00 (130,019,154)	
ドミニカペソ	DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	31,524,900.00	
ドミニカペソ 小計		33,000,000.00	31,524,900.00 (87,863,048)	
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	17,421,750.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	54,531,676.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	44,173,890.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	64,900,000.00	45,686,355.00	

	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	21,238,080.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	57,000,000.00	39,958,710.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	52,285,545.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	12,464,343.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	51,500,000.00	36,344,580.00	
	CZGB 1% 06/26/26	62,800,000.00	52,695,480.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	62,700,000.00	56,752,905.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	63,300,000.00	52,970,706.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	80,500,000.00	66,580,745.00	
	CZGB 2% 10/13/33	64,500,000.00	45,289,320.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	17,749,820.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	29,664,480.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	44,879,532.00	
	CZGB 5% 09/30/30	20,000,000.00	18,850,600.00	
	CZGB 6% 02/26/26	39,500,000.00	39,545,030.00	
	チェココロナ 小計	915,900,000.00	749,083,547.00 (4,470,530,608)	
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	416,855,505.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	222,500,000.00	201,104,400.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	341,506,740.00	
	HGB 1% 11/26/25	635,000,000.00	440,912,250.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	712,000,000.00	352,148,080.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	122,140,160.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	434,553,040.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	320,725,735.00	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	233,961,650.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	472,559,640.00	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	162,587,040.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	333,064,725.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	330,280,500.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	393,384,000.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	173,956,400.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	300,000,000.00	211,581,000.00	
	HGB 4.75% 11/24/32	300,000,000.00	193,047,000.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	534,190,800.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	476,000,000.00	433,193,320.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	572,000,000.00	451,914,320.00	
	ハンガリーフォリント 小計	9,792,000,000.00	6,553,666,305.00 (2,320,935,046)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	13,386,785.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	11,850,982.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	18,700,000.00	11,201,113.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	14,400,000.00	8,350,848.00	

	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	15,906,572.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	19,800,000.00	18,172,440.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	19,433,276.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	13,570,832.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	20,600,000.00	15,606,560.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	18,516,645.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	25,350,000.00	22,062,105.00	
	POLGB 3.75% 05/25/27	12,100,000.00	9,937,730.00	
	POLGB 4% 10/25/23	12,700,000.00	12,191,365.00	
	ポーランドズロチ 小計	242,200,000.00	190,187,253.00	(5,797,021,583)
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,212,740.00	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	1,200,000.00	1,110,792.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	8,000,000.00	6,559,520.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	12,600,000.00	10,950,786.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	6,000,000.00	4,035,060.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,036,500.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	10,500,000.00	8,347,605.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	6,400,000.00	4,618,432.00	
	ROMGB 4.25% 06/28/23	5,100,000.00	4,959,087.00	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,059,156.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	3,200,000.00	2,909,248.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	4,500,000.00	3,050,730.00	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,106,343.00	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	2,800,000.00	2,204,944.00	
	ROMGB 4% 10/25/23	14,900,000.00	14,274,349.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	7,600,000.00	6,635,332.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	4,830,240.00	
ROMGB 6.7% 02/25/32	5,500,000.00	4,662,790.00		
	ルーマニアレイ 小計	114,200,000.00	96,563,654.00	(2,874,313,724)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	27,300,000.00	23,631,699.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	9,650,000.00	9,638,420.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	18,650,000.00	18,119,967.00	
	MGS 3.582% 07/15/32	3,500,000.00	3,267,320.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	19,000,000.00	18,400,740.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	18,350,000.00	15,875,869.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,143,949.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	7,569,256.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	6,100,000.00	6,100,610.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	19,632,536.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	10,300,000.00	10,144,676.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	14,450,000.00	14,319,661.00	

	MGS 3.906% 07/15/26	19,700,000.00	19,556,781.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	23,000,000.00	23,007,360.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000.00	19,719,889.50	
	MGS 4.065% 06/15/50	12,450,000.00	10,705,755.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,189,908.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	19,154,567.00	
	MGS 4.504% 04/30/29	3,200,000.00	3,229,056.00	
	MGS 4.696% 10/15/42	6,200,000.00	6,079,410.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	9,550,000.00	9,691,340.00	
	マレーシアリングット 小計	285,700,000.00	274,178,770.00 (8,698,540,821)	
タイパーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	102,500,000.00	100,767,750.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	137,729,232.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	197,000,000.00	194,748,290.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	47,178,612.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	51,893,814.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	99,100,000.00	90,053,161.00	
	THAIGB 1% 06/17/27	176,000,000.00	163,440,640.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	113,600,000.00	111,654,032.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	123,000,000.00	124,061,490.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	90,100,000.00	73,214,359.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	101,054,540.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	57,526,554.00	
	THAIGB 2% 12/17/31	31,000,000.00	28,283,160.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	122,700,000.00	113,957,625.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	124,428,644.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	99,000,000.00	100,583,010.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000.00	182,075,985.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	188,820,000.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	110,488,712.00	
THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	133,186,335.00		
	タイパーツ 小計	2,310,300,000.00	2,235,145,945.00 (8,717,069,185)	
フィリピン ペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	27,135,600.00	
	フィリピンペソ 小計	30,000,000.00	27,135,600.00 (69,013,971)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,645,171,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,330,475,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	26,000,000,000.00	24,194,040,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	36,500,000,000.00	34,988,535,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	50,300,000,000.00	50,401,103,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	15,191,520,000.00	

	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	15,885,076,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	41,000,000,000.00	38,180,430,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	2,100,000,000.00	1,900,374,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	58,541,875,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	30,000,000,000.00	29,766,600,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	18,720,200,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	28,300,000,000.00	27,331,857,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	34,010,540,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	19,867,844,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	34,700,000,000.00	34,671,546,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	18,518,864,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	40,800,000,000.00	40,790,616,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	43,000,000,000.00	42,071,200,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	46,800,000,000.00	47,946,132,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,200,000,000.00	32,833,320,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	36,000,000,000.00	37,784,880,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,161,790,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	53,600,000,000.00	54,913,200,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	46,661,120,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	22,728,308,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	42,073,321,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	25,506,414,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,910,500,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,167,052,000.00	
	インドネシアルピア 小計	886,000,000,000.00	890,693,903,000.00	(8,639,730,859)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	189,400,000.00	197,534,730.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	45,859,274.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	64,100,000.00	38,845,241.00	
	SAGB 7% 02/28/31	64,700,000.00	50,227,904.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	129,000,000.00	106,400,490.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	113,700,000.00	87,701,358.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	116,000,000.00	88,016,160.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	158,200,000.00	119,445,746.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	110,000,000.00	89,996,500.00	
	SAGB 8% 01/31/30	182,600,000.00	156,915,484.00	
	SAGB 9% 01/31/40	100,300,000.00	79,102,598.00	
	南アフリカランド 小計	1,300,200,000.00	1,060,045,485.00	(8,671,172,067)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,524,792.00	
	CGB 2.18% 08/25/25	7,400,000.00	7,389,492.00	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	3,006,600.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	8,000,000.00	8,033,680.00	

CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,403,132.00	
CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,009,840.00	
CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,225,471.00	
CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,110,300.00	
CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,688,373.00	
CGB 2.75% 06/15/29	6,500,000.00	6,529,900.00	
CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,100,080.00	
CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,858,067.00	
CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,703,968.00	
CGB 2.88% 11/05/23	6,900,000.00	6,977,142.00	
CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,085,680.00	
CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,103,380.00	
CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,413,080.00	
CGB 3.01% 05/13/28	15,000,000.00	15,371,400.00	
CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,679,095.00	
CGB 3.02% 10/22/25	12,900,000.00	13,197,345.00	
CGB 3.03% 03/11/26	7,500,000.00	7,680,825.00	
CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,570,200.00	
CGB 3.13% 11/21/29	15,300,000.00	15,767,721.00	
CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,589,953.00	
CGB 3.22% 12/06/25	5,600,000.00	5,766,992.00	
CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,713,680.00	
CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,703,451.00	
CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,891,000.00	
CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,083,829.00	
CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,816,280.00	
CGB 3.29% 10/18/23	10,000,000.00	10,149,500.00	
CGB 3.53% 10/18/51	7,500,000.00	8,042,400.00	
CGB 3.72% 04/12/51	7,300,000.00	8,043,505.00	
CGB 3.81% 09/14/50	16,500,000.00	18,436,605.00	
オフショア人民元 小計	409,300,000.00	419,666,758.00 (8,661,586,151)	
合計		83,988,416,401 (83,988,416,401)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	10.3%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	10.9%
チリペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	2.0%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	3.8%
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 19銘柄	100.0%	5.3%
ハンガリーフォリント	国債証券 20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 18銘柄	100.0%	3.4%
マレーシアリンギット	国債証券 21銘柄	100.0%	10.4%
タイバーツ	国債証券 20銘柄	100.0%	10.4%
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%	10.3%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	10.3%
オフショア人民元	国債証券 34銘柄	100.0%	10.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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10月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,085,845,648
投資証券	109,914,793,800
未収入金	56,174,824
未収配当金	1,081,783,197
前払金	282,075,200
差入委託証拠金	237,820,000
流動資産合計	114,658,492,669
資産合計	114,658,492,669
負債の部	
流動負債	

	2022年10月20日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	282,075,200
未払金	595,641,448
未払解約金	529,495
未払利息	5,979
流動負債合計	878,252,122
負債合計	878,252,122
純資産の部	
元本等	
元本	55,236,397,859
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	58,543,842,688
元本等合計	113,780,240,547
純資産合計	113,780,240,547
負債純資産合計	114,658,492,669

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年10月20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>
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>不動産投信指数先物取引</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>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)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10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		55,236,397,859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)	2.0599円 (20,599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10月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2022年10月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 4月21日
期首元本額	53,331,017,445円
期中追加設定元本額	4,238,597,725円
期中一部解約元本額	2,333,217,311円
期末元本額	55,236,397,859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）	1,727,625,344円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,362,326円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,711,482,740円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	26,510,530,052円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,181,434,973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

区分	2022年10月20日現在
SMT インデックスバランス・オープン	26,526,688円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	229,316,589円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,310,781円
グローバル経済コア	246,091,450円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,834,328円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	504,977,132円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	92,325,307円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	203,907,478円
10資産分散投資ファンド	7,002円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	526,098,608円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	19,728,785円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	534,573,889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）	79,918,170円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	847,888,402円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	256,010,216円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	291,921,958円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	9,945,649,427
合計	9,945,649,427

(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10月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益	
			(円)		(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引	4,131,657,200	-	3,849,582,000	282,075,200
	買建				
合計		4,131,657,200	-	3,849,582,000	282,075,200

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,143	230,586,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,378	305,371,200	
	S O S i L A 物流リート投資法人	4,929	679,216,200	
	東海道リート投資法人	1,278	149,270,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,641	2,217,369,000	
	森ヒルズリート投資法人	12,399	1,885,887,900	
	産業ファンド投資法人	15,757	2,447,062,100	
	アドバンス・レジデンス投資法人	10,542	3,478,860,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,562	1,553,234,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,567	2,307,521,500	
	G L P 投資法人	33,081	4,836,442,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,905	1,469,047,500	
	日本プロロジスリート投資法人	17,277	5,120,902,800	
	星野リゾート・リート投資法人	1,844	1,231,792,000	
	O n e リート投資法人	1,839	429,590,400	
	イオンリート投資法人	11,672	1,775,311,200	
	ヒューリックリート投資法人	9,865	1,604,049,000	
	日本リート投資法人	3,425	1,203,887,500	
	積水ハウス・リート投資法人	32,043	2,518,579,800	
	トーセイ・リート投資法人	2,339	321,612,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	4,584	1,166,628,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	2,600	485,680,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,741	316,859,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	34,097	5,421,423,000	
	いちごホテルリート投資法人	1,747	179,242,200	
	ラサールロジポート投資法人	12,908	1,994,286,000	
	スターアジア不動産投資法人	13,165	703,011,000	
マリモ地方創生リート投資法人	1,317	175,029,300		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,165	1,951,302,500		
大江戸温泉リート投資法人	1,702	113,523,400		

投資法人みらい	12,810	597,586,500	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,474	325,083,600	
三菱地所物流リート投資法人	3,395	1,388,555,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	4,084	789,437,200	
ザイマックス・リート投資法人	1,710	199,386,000	
タカラレーベン不動産投資法人	4,618	442,404,400	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	4,596	640,222,800	
日本ビルファンド投資法人	12,300	7,601,400,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,544	6,115,520,000	
日本都市ファンド投資法人	53,200	5,405,120,000	
オリックス不動産投資法人	21,009	3,827,839,800	
日本プライムリアルティ投資法人	7,211	2,722,152,500	
N T T 都市開発リート投資法人	10,136	1,443,366,400	
東急リアル・エステート投資法人	7,069	1,389,765,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,224	762,854,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	23,736	3,493,939,200	
森トラスト総合リート投資法人	7,536	1,017,360,000	
インヴィンシブル投資法人	46,408	2,174,214,800	
フロンティア不動産投資法人	3,912	1,954,044,000	
平和不動産リート投資法人	7,206	1,044,149,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,109	2,164,690,500	
福岡リート投資法人	5,453	884,476,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	3,099	2,054,637,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,640	711,072,000	
大和証券オフィス投資法人	2,204	1,454,640,000	
阪急阪神リート投資法人	4,763	693,492,800	
スターツプロシード投資法人	1,642	371,913,000	
大和ハウスリート投資法人	15,894	4,525,021,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,002	2,587,552,200	
大和証券リビング投資法人	14,611	1,602,826,700	
ジャパンエクセレント投資法人	9,673	1,257,490,000	
合計	622,780	109,914,793,800	

(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10月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	518,709,583
コール・ローン	20,996,509
投資証券	90,452,373,882
派生商品評価勘定	47,472
未収入金	1
未収配当金	72,209,569
流動資産合計	91,064,337,016
資産合計	91,064,337,016
負債の部	
流動負債	
未払金	32,600,880
未払解約金	8,401,840
未払利息	40
流動負債合計	41,002,760
負債合計	41,002,760
純資産の部	
元本等	
元本	38,320,438,582
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	52,702,895,674
元本等合計	91,023,334,256
純資産合計	91,023,334,256
負債純資産合計	91,064,337,016

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年10月20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>

2022年10月20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)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2022年10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	38,320,438,582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 2.3753円 (1万口当たり純資産額) (23,753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10月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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。

	2022年10月20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10月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 4月21日
期首元本額	38,854,299,591円
期中追加設定元本額	4,541,912,145円
期中一部解約元本額	5,075,773,154円
期末元本額	38,320,438,582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）	94,091,235円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,688,497,853円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,346,776円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,492,368,901円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	16,616,038,454円
コア投資戦略ファンド（安定型）	387,769,767円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,166,221,268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	1,470,010,390円
コア投資戦略ファンド（切替型）	471,514,266円
SMT インデックスバランス・オープン	133,468,432円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	192,567,868円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,075,716円
グローバル経済コア	238,008,555円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,282,609円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	345,064,516円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	63,337,930円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	45,959,387円
10資産分散投資ファンド	3,975円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,161,459,166円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	207,575,155円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	149,753,337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）	60,705,130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）	32,805,089円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	100,614,514円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	92,238,456円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	91,762,324円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	97,458,043円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	96,415,726円

区分	2022年10月20日現在
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）	78,211,546円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	32,537,535,689	
合計	32,537,535,689	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年10月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	8,951,400	-	8,997,864	46,464
	アメリカドル	8,951,400	-	8,997,864	46,464
	売建	60,417,760	-	60,416,752	1,008
	アメリカドル	60,417,760	-	60,416,752	1,008
合計		69,369,160	-	69,414,616	47,472

（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
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	47,870	623,746.10	
		AGREE REALTY CORP	42,456	2,742,657.60	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	36,712	651,270.88	
		ALEXANDER'S INC	1,190	253,838.90	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	77,628	10,137,440.52	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	96,558.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	26,331	674,600.22	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	157,776	4,968,366.24	
		AMERICOLD REALTY TRUST	140,152	3,116,980.48	
		APARTMENT INCOME REIT CO	80,136	2,951,408.88	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	80,641	578,195.97	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	112,511	1,811,427.10	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,600	417,266.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	131,070.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	73,614	12,760,986.90	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,856	45,546.24	
		BOSTON PROPERTIES	74,398	5,343,264.36	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	137,186.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	570,145.80	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	155,764	2,975,092.40	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	91,391	1,445,805.62	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	104,800.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	55,612	6,269,140.76	
		CARETRUST REIT INC	50,775	883,992.75	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	13,620	356,026.80	
		CENTERSPACE	7,690	505,233.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	299,755.20	
		CITY OFFICE REIT INC	25,050	243,987.00	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	49,202.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	396,735.09	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	59,303	1,432,760.48	
		COUSINS PROPERTIES INC	80,225	1,774,577.00	
		CTO REALTY GROWTH INC	8,400	155,400.00	
		CUBESMART	116,995	4,517,176.95	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	110,151	966,024.27	
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	108,174.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	151,273	14,402,702.33	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	123,808.00	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	92,978	1,525,768.98	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	

EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	46,047	728,463.54	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	22,657	3,221,598.83	
ELME COMMUNITIES	44,370	779,580.90	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	68,118	453,665.88	
EPR PROPERTIES	39,586	1,463,098.56	
EQUINIX INC	47,884	25,163,999.68	
EQUITY COMMONWEALTH	58,699	1,466,301.02	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	91,267	5,360,110.91	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	178,275	11,343,638.25	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	74,549	1,429,104.33	
ESSEX PROPERTY TRUST	34,016	7,725,713.92	
EXTRA SPACE STORAGE INC	70,511	11,699,185.12	
FARMLAND PARTNERS INC	27,128	359,174.72	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	37,891	3,456,795.93	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	68,669	3,028,302.90	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,515	1,060,792.45	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	114,932.50	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	133,365	6,073,442.10	
GETTY REALTY CORP	21,405	599,768.10	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	328,042.00	
GLADSTONE LAND CORP	18,500	354,830.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	265,332.60	
GLOBAL NET LEASE INC	57,012	616,299.72	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	198,188	3,769,535.76	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	284,795	6,424,975.20	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	18,550	151,739.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	54,171	1,377,568.53	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	377,326	6,614,524.78	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	67,058	683,991.60	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	117,606	1,828,773.30	
INDUS REALTY TRUST INC	3,840	194,995.20	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	167,488.30	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	14,395	1,346,652.25	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	34,233	768,873.18	
INVITATION HOMES INC	305,504	9,928,880.00	
IRON MOUNTAIN INC	151,806	7,019,509.44	
ISTAR INC	47,982	425,600.34	
JBG SMITH PROPERTIES	54,180	1,015,333.20	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	237,350.00	
KILROY REALTY CORPORATION	55,859	2,299,715.03	
KIMCO REALTY CORP	322,831	6,166,072.10	

KITE REALTY GROUP TRUST	116,156	2,060,607.44
LIFE STORAGE INC	43,985	4,531,774.55
LTC PROPERTIES INC	20,559	782,681.13
LXP INDUSTRIAL TRUST	147,610	1,355,059.80
MACERICH CO/THE	114,305	1,056,178.20
MANULIFE US REAL ESTATE INV	957,964	349,656.86
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	311,716	3,428,876.00
MID-AMERICA APARTMENT COMM	60,324	8,904,425.64
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	92,194	3,627,833.90
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	44,109	1,767,006.54
NATL HEALTH INVESTORS INC	22,932	1,253,004.48
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	71,590	438,846.70
NETSTREIT CORP	28,637	506,302.16
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	491,967.19
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	403,535.00
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	121,870	3,653,662.60
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	191,499.73
ORION OFFICE REIT INC	30,374	272,151.04
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	574,246.40
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	115,733	1,433,931.87
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	67,222	1,054,040.96
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	61,777	1,746,435.79
PHYSICIANS REALTY TRUST	119,795	1,720,256.20
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	653,428.88
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	24,051	420,651.99
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	105,560.00
PRIME US REIT	295,000	138,650.00
PROLOGIS INC	485,124	49,487,499.24
PUBLIC STORAGE	83,072	24,165,644.80
REALTY INCOME CORP	324,871	18,787,289.93
REGENCY CENTERS CORP	80,269	4,360,212.08
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	67,292	916,517.04
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	89,170	4,576,204.40
RLJ LODGING TRUST	85,057	969,649.80
RPT REALTY	43,950	374,454.00
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	29,264	2,478,953.44
SABRA HEALTH CARE REIT INC	122,082	1,541,895.66
SAFEHOLD INC	8,335	209,041.80
SAUL CENTERS INC	6,800	253,912.00
SERVICE PROPERTIES TRUST	87,336	675,107.28
SIMON PROPERTY GROUP	172,224	16,883,118.72

	SITE CENTERS CORP	95,414	1,076,269.92
	SL GREEN REALTY CORP	33,907	1,262,696.68
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	72,464	2,534,066.08
	STAG INDUSTRIAL INC	95,287	2,686,140.53
	STORE CAPITAL CORP	138,477	4,356,486.42
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	421,641.20
	SUN COMMUNITIES INC	65,021	7,887,047.30
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	111,465	1,172,611.80
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	53,139	876,262.11
	TERRENO REALTY CORP	35,221	1,857,907.75
	UDR INC	159,427	6,195,333.22
	UMH PROPERTIES INC	25,129	408,597.54
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	311,553.64
	URBAN EDGE PROPERTIES	59,760	797,198.40
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	262,020.50
	VENTAS INC	210,788	7,824,450.56
	VERIS RESIDENTIAL INC	42,236	520,347.52
	VICI PROPERTIES INC	506,814	14,900,331.60
	VORNADO REALTY TRUST	85,374	1,843,224.66
	WELLTOWER INC	243,875	14,469,103.75
	WHITESTONE REIT	23,074	196,590.48
	WP CAREY INC	109,453	7,738,327.10
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	58,232	933,458.96
	アメリカドル 小計	13,758,695	473,195,308.97 (70,969,832,439)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	34,242	923,164.32
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	279,945.90
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	150,720.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,360	518,356.80
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	180,785.00
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	65,400.00
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	44,274	1,746,166.56
	CHOICE PROPERTIES REIT	82,270	1,033,311.20
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	381,379.95
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	410,404.00
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	69,960	731,082.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	212,413.40
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	67,876.00
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	852,799.15
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,935	1,031,950.60

	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	69,239	738,780.13
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	38,019.00
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,790	368,986.80
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	445,660.50
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	146,853.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	190,900.90
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	134,526.00
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	55,670	567,834.00
	PRIMARIS REIT	28,309	371,980.26
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	92,640.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	76,984	1,428,053.20
	SLATE GROCERY REIT	17,300	234,415.00
	SLATE OFFICE REI	17,000	76,160.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	36,430	947,544.30
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	45,430	786,847.60
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	156,864.00
	カナダドル 小計	979,910	15,311,819.57 (1,667,457,151)
ユーロ	AEDIFICA	20,337	1,517,140.20
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	57,240.00
	ALTAREA	2,480	327,360.00
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	232,500.00
	CARMILA	32,392	437,292.00
	COFINIMMO	15,207	1,241,651.55
	COVIVIO(FP)	24,511	1,201,039.00
	CROMWELL REIT EUR	203,300	313,082.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	21,860	448,130.00
	GECINA SA	27,759	2,294,281.35
	HAMBORNER REIT AG	37,000	247,530.00
	ICADE	15,570	557,717.40
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	90,050.35
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	146,716	707,757.98
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	251,075.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	237,300.00
	KLEPIERRE	102,827	1,987,131.77
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	134,980.00
	MERCIALYS	43,384	357,267.24
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	175,230	1,393,078.50
	MONTEA NV	6,930	446,985.00
	NSI NV	10,050	226,627.50

	RETAIL ESTATES	6,400	360,320.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	56,878	2,506,897.85	
	VASTNED RETAIL	10,650	199,155.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	72,628	1,791,006.48	
	WERELDHAVE NV	22,670	259,344.80	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	12,170	330,415.50	
	ユーロ 小計	1,379,039	20,154,356.47 (2,951,807,048)	
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	260,756	137,418.41	
	AEW UK REIT PLC	68,000	60,044.00	
	ASSURA PLC	1,522,040	758,280.32	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	435,000	339,300.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	87,868	900,647.00	
	BRITISH LAND CO PLC	494,961	1,688,311.97	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	425,878	421,619.22	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	191,768.92	
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	197,026.11	
	DERWENT LONDON PLC	58,972	1,154,082.04	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	67,100.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	241,740.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	124,430	568,645.10	
	HAMMERSON PLC	2,044,000	379,059.80	
	HOME REIT PLC	419,934	364,502.71	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	229,355	215,593.70	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	397,139	2,047,648.68	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	505,880	858,478.36	
	LXI REIT PLC	915,946	1,053,337.90	
	NEWRIVER REIT PL	126,000	87,822.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	203,948.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	690,888	707,469.31	
	PRS REIT PLC/THE	329,000	289,191.00	
	REGIONAL REIT LTD	222,000	142,746.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	111,437	920,469.62	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	143,850.00	
SEGRO PLC	638,807	4,570,025.27		
SHAFTESBURY PLC	139,823	478,474.30		
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	610,839	586,405.44		
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	128,070.18		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	977,031	1,277,956.54		
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	274,400.00		
UNITE GROUP PLC	204,884	1,705,659.30		

	URBAN LOGISTICS REIT PLC	260,000	322,400.00	
	WAREHOUSE REIT PLC	230,000	254,840.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	81,347	307,491.66	
	イギリスポンド 小計	15,425,804	24,055,092.86 (4,041,496,151)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	239,716	616,070.12	
	ARENA REIT	196,553	687,935.50	
	BWP TRUST	262,160	980,478.40	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	580,769.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	309,606	845,224.38	
	CENTURIA OFFICE REIT	240,945	345,756.07	
	CHARTER HALL GROUP	239,403	2,935,080.78	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	324,342	1,333,045.62	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	264,212	1,022,500.44	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	604,026.50	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	822,633	559,390.44	
	DEXUS	554,708	4,282,345.76	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	283,630.00	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	256,355.00	
	GOODMAN GROUP	886,550	14,814,250.50	
	GPT GROUP	986,304	3,974,805.12	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	530,296.80	
	HEALTHCO REIT	137,130	201,581.10	
	HOME CONSORTIUM LTD	111,500	503,980.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	807,262	960,641.78	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	353,655.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	193,766	745,999.10	
	MIRVAC GROUP	2,032,711	3,963,786.45	
	NATIONAL STORAGE REIT	534,270	1,292,933.40	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	133,448.00	
	RURAL FUNDS GROUP	231,095	568,493.70	
	SCENTRE GROUP	2,693,644	7,111,220.16	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	578,101	1,439,471.49		
STOCKLAND	1,230,179	4,108,797.86		
VICINITY CENTERS	1,989,627	3,581,328.60		
WAYPOINT REIT LTD	390,099	1,006,455.42		
	オーストラリアドル 小計	17,714,951	60,623,752.49 (5,690,751,646)	
ニュージ ーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	475,696.92	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	605,300	1,171,255.50	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	734,008.95	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	762,894	892,585.98	

	STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	450,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	249,502	598,804.80	
ニュージーランドドル 小計		3,193,464	4,322,352.15 (367,054,144)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,108,000	3,002,680.00	
	FORTUNE REIT	736,000	3,922,880.00	
	LINK REIT	1,113,900	57,477,240.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	1,368,640.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,570,800.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,315,660	2,039,273.00	
香港ドル 小計		5,586,560	69,381,513.00 (1,325,880,713)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	319,000.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,735,718	4,460,795.26	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	969,977	868,129.41	
	CAPITALAND CHINA TRUST	647,721	612,096.34	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,603,044	4,711,509.64	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	473,600	478,336.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400	187,188.00	
	EC WORLD REIT	180,000	87,300.00	
	ESR-LOGOS REIT	2,763,464	911,943.12	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	291,600.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	129,144.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	532,862	1,092,367.10	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,507,996	1,658,795.60	
	KEPPEL DC REIT	682,103	1,139,112.01	
	KEPPEL REIT	1,014,500	913,050.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	1,025,950	707,905.50	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,047,463	2,314,893.23	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,721,285	2,547,501.80	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	1,208,173	1,933,076.80	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,273,644	388,461.42	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	195,500	752,675.00		
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	204,102.00		
SPH REIT	577,800	470,907.00		
STARHILL GLOBAL REIT	849,400	420,453.00		
SUNTEC REIT	1,171,700	1,663,814.00		
シンガポールドル 小計		24,159,200	29,264,156.23 (3,080,345,084)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	91,638,800.00	

	E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	62,832,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	313,159,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	45,012,000.00	
	JR REIT XXVII	76,683	315,933,960.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	111,905,200.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	290,644,800.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	166,216,500.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	46,042,920.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	36,380	240,108,000.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	49,703,500.00	
	SK REITS CO LTD	39,229	183,003,285.00	
	韓国ウォン 小計	456,338	1,916,199,965.00 (200,626,136)	
イスラエル シェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	656,280.00	
	REIT 1 LTD	103,500	2,017,215.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	1,035,000.00	
	イスラエルシェケル 小計	578,500	3,708,495.00 (157,123,370)	
	合計	83,232,461	90,452,373,882 (90,452,373,882)	

(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 145銘柄	100.0%	78.5%
カナダドル	投資証券 31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 37銘柄	100.0%	4.5%
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 6銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	投資証券 25銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券 12銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3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。

新興国REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	13,564,341
コール・ローン	612,692
投資証券	503,559,173
未収配当金	383,933
流動資産合計	518,120,139
資産合計	518,120,139
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,751,750
未払利息	1
流動負債合計	1,751,751
負債合計	1,751,751
純資産の部	
元本等	
元本	687,059,192
剰余金	
剰余金又は欠損金()	170,690,804
元本等合計	516,368,388
純資産合計	516,368,388
負債純資産合計	518,120,139

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年10月20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>

2022年10月20日現在	
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。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2022年10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	687,059,192口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 170,690,804円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.7516円 (1万口当たり純資産額) (7,516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10月20日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年10月20日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 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10月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 4月21日
期首元本額	688,335,956円
期中追加設定元本額	33,384,824円
期中一部解約元本額	34,661,588円
期末元本額	687,059,192円
期末元本額の内訳	
SMT インデックスバランス・オープン	241,785,864円
SMT 新興国REITインデックス・オープン	445,273,328円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	18,806,121
合計	18,806,121

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「新興国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）

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
----	----	----	------	-----	----

投資証券	メキシコペソ	CONCENTRADORA FIBRA DANHOS S	94,100	2,255,577.00		
		FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	322,600	7,132,686.00		
		MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	79,000	1,968,680.00		
		PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	85,800	2,362,074.00		
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	65,700	3,089,871.00		
	メキシコペソ 小計			647,200	16,808,888.00	(125,295,132)
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	206,442		918,666.90	
		IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	51,071		307,958.13	
		KIZILBUK GAYRIMENKUL YATIRIM	6,200		112,406.00	
		SINPAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	76,700		405,743.00	
		YENI GIMAT GAYRIMENKUL ORTAK	19,138		442,087.80	
		ZIRAAT GAYRIMENKUL YATIRIM O	104,000		426,400.00	
	トルコリラ 小計			463,551	2,613,261.83	(21,096,862)
	香港ドル	CHINA MERCHANTS COMMERCIAL R	59,000		104,430.00	
		SF REAL ESTATE INVESTMENT TR	58,000		162,400.00	
	香港ドル 小計			117,000	266,830.00	(5,099,121)
	マレーシアリンギット	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	153,200		281,888.00	
		IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	183,000		289,140.00	
		PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	73,000		91,250.00	
		SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	209,000		300,960.00	
	マレーシアリンギット 小計			618,200	963,238.00	(30,559,496)
	タイバーツ	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	208,500		3,857,250.00	
		FRASERS PROPERTY THAILAND IN	164,600		1,678,920.00	
		IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	71,500		879,450.00	
		WHA INDUSTRIAL LEASEHOLD REA	83,000		597,600.00	
WHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD		160,300		1,603,000.00		
タイバーツ 小計			687,900	8,616,220.00	(33,603,258)	
フィリピンペソ	AREIT INC	69,520		2,155,120.00		
	CITICORE ENERGY REIT CORP	303,000		672,660.00		
	FILINVEST REIT CORP	182,300		1,046,402.00		
	MREIT INC	106,000		1,367,400.00		
	RL COMMERCIAL REIT INC	404,000		2,020,000.00		
フィリピンペソ 小計			1,064,820	7,261,582.00	(18,468,381)	
インドルピー	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	17,151		5,415,942.78		
	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	67,409		23,268,238.62		

	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	24,792	9,031,229.76	
	インドルピー 小計	109,352	37,715,411.16 (68,642,048)	
南アフリカ ランド	ATTACQ LTD	81,466	549,895.50	
	EMIRA PROPERTY FUND LTD	34,614	359,985.60	
	EQUITES PROPERTY FUND LTD	85,446	1,403,877.78	
	FAIRVEST LTD-B	150,040	475,626.80	
	FORTRESS REIT LTD-A	130,265	1,247,938.70	
	FORTRESS REIT LTD-B	104,008	440,993.92	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	385,123	5,083,623.60	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	37,648	1,414,058.88	
	INVESTEC PROPERTY FUND LTD	70,263	695,603.70	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	742,157	3,050,265.27	
	RESILIENT REIT LTD	38,132	1,956,552.92	
	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	275,044	594,095.04	
	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	50,755	677,579.25	
	VUKILE PROPERTY FUND LTD	104,165	1,438,518.65	
	南アフリカランド 小計	2,289,126	19,388,615.61 (158,598,875)	
サウジアラ ビアリアル	AL MAATHER REIT FUND	3,675	33,993.75	
	AL RAJHI REIT	13,464	134,236.08	
	ALAHLI REIT FUND 1	4,800	54,240.00	
	ALINMA RETAIL REIT FUND	10,174	52,701.32	
	ALKHABEER REIT	8,225	63,168.00	
	DERAYAH REIT	11,621	122,485.34	
	JADWA REIT SAUDI FUND	19,699	261,996.70	
	MUSHARAKA REIT FUND	8,654	79,270.64	
	RIYAD REIT FUND	13,266	149,905.80	
	SEDCO CAPITAL REIT FUND	9,489	103,430.10	
	サウジアラビアリアル 小計	103,067	1,055,427.73 (42,196,000)	
	合計	6,100,216	503,559,173 (503,559,173)	

(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
----	-----	----------------	----------------

メキシコペソ	投資証券	5銘柄	100.0%	24.9%
トルコリラ	投資証券	6銘柄	100.0%	4.2%
香港ドル	投資証券	2銘柄	100.0%	1.0%
マレーシアリングット	投資証券	4銘柄	100.0%	6.1%
タイバーツ	投資証券	5銘柄	100.0%	6.7%
フィリピンペソ	投資証券	5銘柄	100.0%	3.7%
インドルピー	投資証券	3銘柄	100.0%	13.6%
南アフリカランド	投資証券	14銘柄	100.0%	31.5%
サウジアラビアリアル	投資証券	10銘柄	100.0%	8.4%

(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。

2【ファンドの現況】

【SMT インデックスバランス・オープン】

【純資産額計算書】

(2022年11月30日現在)

資産総額	2,705,000,269円
負債総額	7,246,433円
純資産総額（ - ）	2,697,753,836円
発行済口数	2,006,365,947口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3446円
（1万口当たり純資産額）	（13,446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11月30日現在)

資産総額	517,255,438,884円
負債総額	1,345,928,299円
純資産総額（ - ）	515,909,510,585円
発行済口数	259,803,206,145口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9858円
（1万口当たり純資産額）	（19,858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11月30日現在)

資産総額	640,952,352,368円
負債総額	18,039,534,098円
純資産総額（ - ）	622,912,818,270円
発行済口数	460,456,826,138口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3528円
（1万口当たり純資産額）	（13,528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11月30日現在)

資産総額	561,726,435,196円
負債総額	807,444,257円
純資産総額(-)	560,918,990,939円
発行済口数	127,851,739,554口
1口当たり純資産額(/)	4.3873円
(1万口当たり純資産額)	(43,873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11月30日現在)

資産総額	302,576,646,568円
負債総額	124,991,882円
純資産総額(-)	302,451,654,686円
発行済口数	96,917,307,621口
1口当たり純資産額(/)	3.1207円
(1万口当たり純資産額)	(31,207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11月30日現在)

資産総額	115,097,836,866円
負債総額	296,380,361円
純資産総額(-)	114,801,456,505円
発行済口数	32,654,881,538口
1口当たり純資産額(/)	3.5156円
(1万口当たり純資産額)	(35,156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11月30日現在)

資産総額	87,022,601,118円
負債総額	11,868,995円
純資産総額（ - ）	87,010,732,123円
発行済口数	47,523,303,172口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8309円
（1万口当たり純資産額）	（18,309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11月30日現在)

資産総額	133,516,860,320円
負債総額	538,180,844円
純資産総額（ - ）	132,978,679,476円
発行済口数	61,021,135,364口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1792円
（1万口当たり純資産額）	（21,792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11月30日現在)

資産総額	84,851,689,858円
負債総額	302,359,372円
純資産総額（ - ）	84,549,330,486円
発行済口数	34,456,280,389口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4538円
（1万口当たり純資産額）	（24,538円）

新興国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11月30日現在)

資産総額	530,688,151円
負債総額	566,244円
純資産総額（ - ）	530,121,907円

発行済口数	690,095,568口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7682円
（1万口当たり純資産額）	（7,682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。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2022年11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年間ににおける資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

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2023年 1月20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2022年11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	532	13,756,216
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	217,345
単位型公社債投資信託	51	186,563
合計	651	14,160,124

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。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

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、財務諸表及び中間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、第36期事業年度（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。

また、第37期事業年度の中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,589	21,675
金銭の信託	10,857	14,913
前払費用	397	166
未収委託者報酬	8,471	9,067
未収運用受託報酬	6,151	6,252
未収収益	177	179
その他	3,428	4,891
流動資産合計	51,072	57,146
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 301	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
有形固定資産合計	993	976
無形固定資産		
ソフトウェア	4,104	6,292
その他	41	31
無形固定資産合計	4,145	6,324
投資その他の資産		
投資有価証券	9,950	6,607
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	311	907
その他	39	31
投資その他の資産合計	15,937	13,182
固定資産合計	21,077	20,482
資産合計	72,149	77,629

（単位：百万円）

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
固定負債		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

（単位：百万円）

	前事業年度	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）
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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					

当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

（2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債

務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日）を適用する予定であります。

(会計方針の変更)

1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

2. 「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-21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いません。

（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、それら的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あります。

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 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	600	626
勤務費用	-	124
利息費用	-	2
転籍者受入	18	-
退職給付の支払額	69	81
簡便法で計算した退職給付費用	77	8
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
退職給付債務の期末残高	626	820

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

(単位：百万円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

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

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

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

〔セグメント情報等〕

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

〔関連当事者情報〕

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		21,051
金銭の信託		13,989
未収委託者報酬		9,325
未収運用受託報酬		5,831
短期差入証拠金		4,507
その他		3,041
流動資産合計		57,747

固定資産

有形固定資産	1	895
無形固定資産		6,915
投資その他の資産		
投資有価証券		4,202
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,228
その他		31
投資その他の資産合計		11,098

固定資産合計		18,909
--------	--	--------

資産合計		76,657
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,649
未払法人税等		1,537
賞与引当金		321
その他	2	2,111
流動負債合計		11,619

固定負債

退職給付引当金		871
---------	--	-----

資産除去債務	153
その他	20
固定負債合計	1,045
負債合計	12,665

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	42,655
利益剰余金合計	45,255
株主資本合計	64,494
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	278
繰延ヘッジ損益	780
評価・換算差額等合計	502
純資産合計	63,992
負債・純資産合計	76,657

中間損益計算書

(単位：百万円)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		20,422
運用受託報酬		5,485
その他営業収益		178
営業収益合計		26,086
営業費用		15,618
一般管理費	1	6,047
営業利益		4,421
営業外収益	2	2,365
営業外費用	3	1,945
経常利益		4,840
税引前中間純利益		4,840
法人税、住民税及び事業税		1,402
法人税等調整額		90

法人税等合計	1,492
中間純利益	3,347

中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30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
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
中間純利益			3,347	3,347	3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	706	706	706
当中間期末残高	500	2,100	42,655	45,255	64,494

	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	941	509	431	64,219
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,641
中間純利益				3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	663	270	933	933
当中間期変動額合計	663	270	933	227
当中間期末残高	278	780	502	63,992

注記事項

（重要な会計方針）

第37期中間会計期間

（自 2022年4月1日

至 2022年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

（1）有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

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

時価法によっております。

（3）金銭の信託

時価法によっております。

2．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。

3．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中間会計期間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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間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、退職給付に係る当中間会計期間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。

4．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。

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、中間会計期間末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. ヘッジ会計の方法

(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。

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

第37期中間会計期間
(自 2022年4月1日
至 2022年9月30日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「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。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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いたしました。これによる中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

第37期中間会計期間
(自 2022年4月1日
至 2022年9月30日)

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の適用

当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、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については、「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。以下、「実務対応報告第42号」）という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項（1）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

（表示方法の変更）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）
従来「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

（中間貸借対照表関係）

第37期中間会計期間末 （2022年9月30日）
1 有形固定資産の減価償却累計額 777百万円
2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）
1 減価償却実施額
有形固定資産 95百万円
無形固定資産 608百万円
2 営業外収益の主要項目
デリバティブ利益 2,027百万円
投資有価証券売却益 317百万円
3 営業外費用の主要項目
為替差損 1,011百万円
金銭の信託運用損 904百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

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

中間貸借対照表計上額、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 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、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順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額（百万円）(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	952	12,129	-	13,081
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,978	-	3,978
資産計	952	16,107	-	17,060
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	804	(0)	-	804
ヘッジ会計が適用されているもの	-	22	-	22
デリバティブ取引計	804	21	-	826

(*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)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額908百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は13,989百万円であります。

(*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は上記に含めておりません。

(*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）時価をもって中間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、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。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。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、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中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

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中間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）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2．その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	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	2,657	1,966	690
小計	2,657	1,966	690

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,321	1,615	293
小計	1,321	1,615	293
合計	3,978	3,581	397

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30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	6,412	-	5	5
	英ポンド	250	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	164	-	1	1
	香港ドル	219	-	0	0
	ユーロ	721	-	0	0
	買建				
	米ドル	259	-	0	0
香港ドル	2	-	0	0	
合計		8,141	-	0	0

（注）上記取引の評価損益は中間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	13,818	-	804	804
合計		13,818	-	804	804

（注）上記取引の評価損益は中間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	デリバティブ取引 の種類等	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		3,036	-	2
	英ポンド		3,333	-	19
	スイスフラン		70	-	0
	香港ドル		87	-	0
	ユーロ		82	-	0
	買建				
	米ドル		93	-	0
	英ポンド		77	-	2
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		3	-	0
	ユーロ		60	-	1
合計			6,898	-	22

（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）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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4．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中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後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]

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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]

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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中間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中間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中間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

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,950百万円

〔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〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1株当たり純資産額	21,330,712円74銭
1株当たり中間純利益	1,115,947円92銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第37期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
中間純利益	3,347百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	3,347百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

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

2023年1月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

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。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

a u カブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。
フィデリティ証券株式会社	11,757	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ソニー銀行株式会社	38,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社荘内銀行	8,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
アイザワ証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
G M O クリック証券株式会社	4,346	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
あかつき証券株式会社	3,067	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【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
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12月23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 公認会計士 松崎雅則
業務執行社員

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SMT インデックスバランス・オープンの2022年4月21日から2022年10月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT インデックスバランス・オープンの2022年10月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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、継続企業的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。継続企業的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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年12月1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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、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9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的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。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。