

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年2月10日提出
【計算期間】	第11期(自 2022年5月11日至 2022年11月10日)
【ファンド名】	SMT 8資産インデックスバランス・オープン
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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。

## &lt;信託金限度額&gt;

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。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グロ ー バ ル  (日本を 含む)	ファミリ ー ファン ド  ファン ド・ オブ・ファ ンズ	あり ( )  なし	日経225  TOPIX  その他 ( )	ブル・ベア型  条件付運用型  ロ ン グ・ ショ ー ト型/ 絶対収益追求 型  その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	日本  北米  欧州  アジア  オセアニ ア  中南米  アフリカ  中近東 (中東)				
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分固定型))	その他 ( )					
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 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 ]

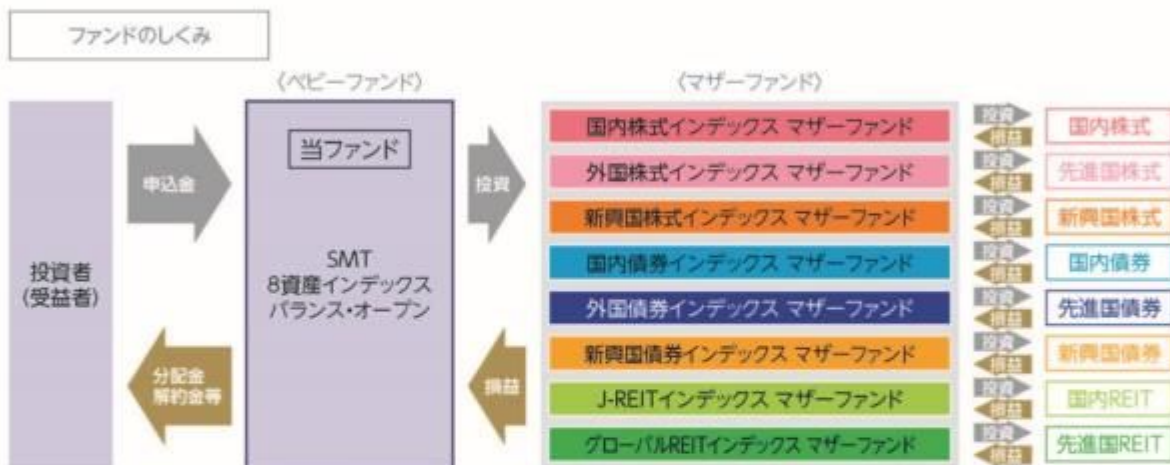
- (1) ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、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

国内及び海外の株式(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。

- 国内、先進国及び新興国の株式及び債券、並びに国内及び先進国の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** 8つのマザーファンド受益証券への均等配分を基本配分比率とします。

基本配分比率



●配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

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

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章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
- ※7 「東証REIT指数(配当込み)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※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<sup>®</sup>及びS&P<sup>®</sup>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<sup>®</sup>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、これら関係者のいづれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。

## 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50%以下とします。
- 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、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は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年 8月25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」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「グローバル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」ということがあります。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

### 投資態度

- イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）及び債券、並びに国内及び先進国の不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。
- ロ．各マザーファンド受益証券の基本配分比率は、8分の1ずつの均等配分とします。また、各マザーファンド受益証券の配分比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ハ．各マザーファンドは、インデック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。

マザーファンド	インデックス
国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX（東証株価指数）
外国株式インデックス マザーファンド	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
新興国株式インデックス マザーファンド	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債券インデックス マザーファンド	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）
J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）
グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）

- ニ．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。
- ホ．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」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」及び「グローバル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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
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がた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およ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・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、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号口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。

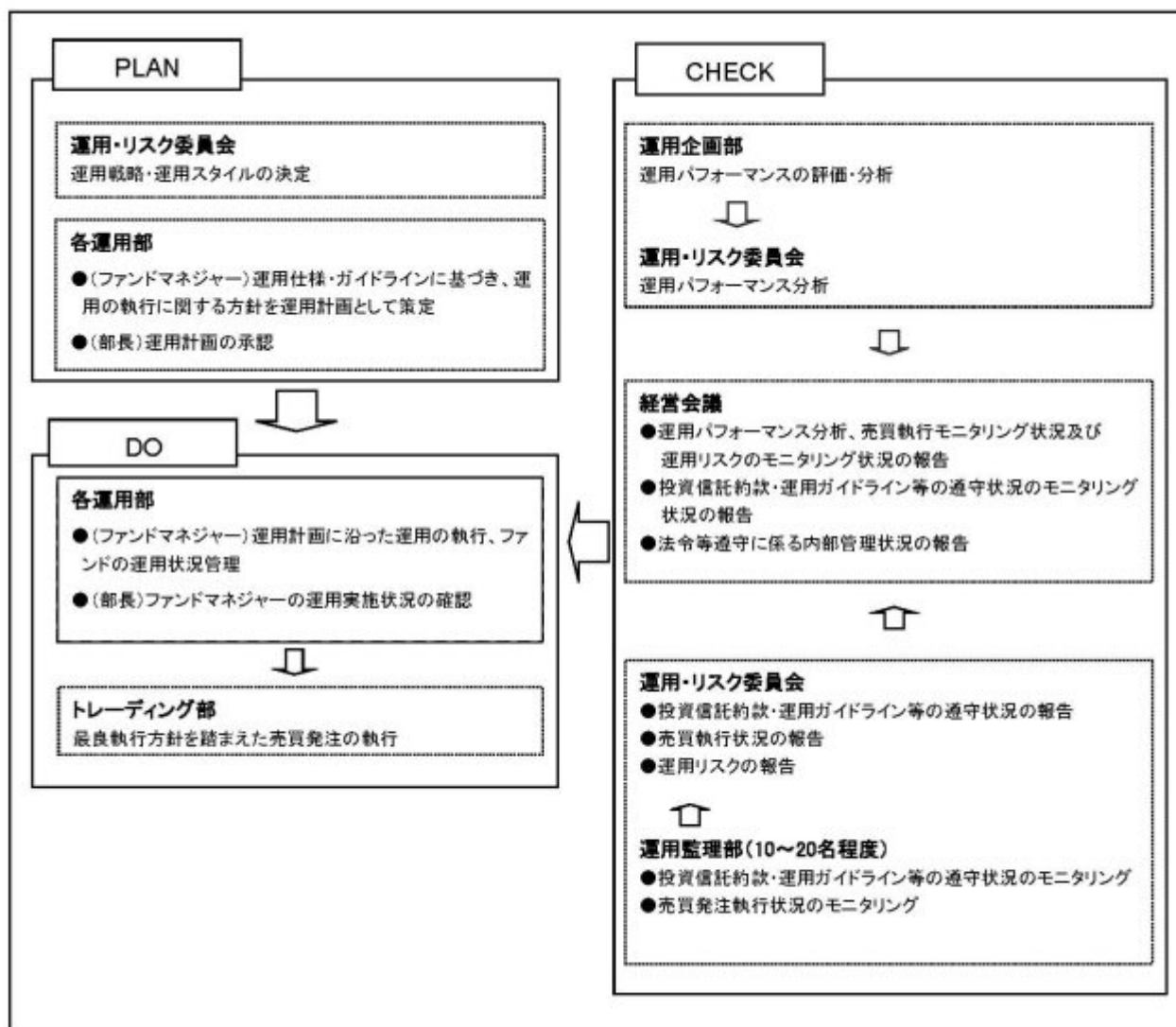
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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。

## (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50%以下とします。

#### ロ．投資信託証券への投資割合

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

#### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。

#### 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17項に規定する取引所金融商品市場並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。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

#### ホ．信用取引の指図範囲

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

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

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

#### 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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

## ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

## ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産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、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)において投資信託財産に属するとみなした額とは、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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

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

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は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、全て投資者の皆様はに帰属します。

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。

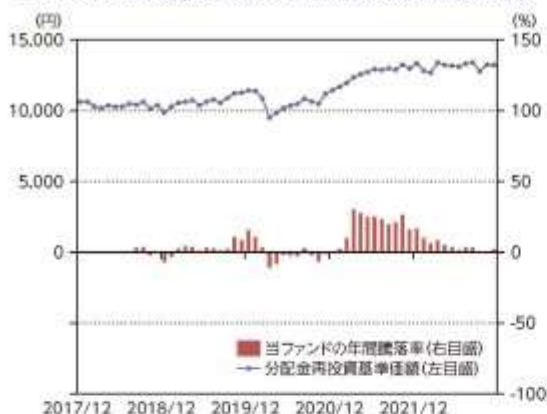
## (2) リスクの管理体制

### 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



\*当ファンドについては2018年8月～2022年11月の4年4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては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・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

\*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数、配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、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、配当利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義務は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社(以下「JPX」といふ。)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義務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必要とするいかなる措置に対しても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.が算出した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを測る株価指数で、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、配当利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.が算出した世界の新興国株式市場の動きを測る株価指数で、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、配当利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、野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された、公募固定利付国債の市場全体の動向を要約する投資収益指数で、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算出されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社は、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該の事業活動・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、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を持っておりません。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、遅延又は中断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権の一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morganグローバル・エマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	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されています。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す。

## （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いません。

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。 ）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」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。つみたてNISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象

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。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。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 8資産インデックスパランス・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	148,649,545	99.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,437,478	0.96
合計（純資産総額）		150,087,023	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	国内株式インデックス マザーファンド	9,942,065	1.9371	19,259,689	1.9858	19,742,952	13.15
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	4,401,281	4.3607	19,192,842	4.3873	19,309,740	12.87
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	10,517,156	1.8494	19,451,192	1.8309	19,255,860	12.83
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	8,635,877	2.1472	18,543,432	2.1792	18,819,303	12.54
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	5,905,158	3.1671	18,702,303	3.1207	18,428,226	12.28
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	5,173,811	3.4917	18,065,839	3.5156	18,189,049	12.12
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	7,359,837	2.4413	17,967,743	2.4538	18,059,568	12.03
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	12,451,839	1.3550	16,873,477	1.3528	16,844,847	11.22

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

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

## 【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	(2017年11月10日)	3,305,848	3,305,848	10,426	10,426
第2期計算期間末	(2018年 5月10日)	8,441,994	8,441,994	10,414	10,414
第3期計算期間末	(2018年11月12日)	14,205,908	14,205,908	10,346	10,346
第4期計算期間末	(2019年 5月10日)	23,476,764	23,476,764	10,471	10,471
第5期計算期間末	(2019年11月11日)	32,350,523	32,350,523	11,176	11,176
第6期計算期間末	(2020年 5月11日)	38,971,244	38,971,244	9,884	9,884
第7期計算期間末	(2020年11月10日)	58,213,200	58,213,200	11,058	11,058
第8期計算期間末	(2021年 5月10日)	83,447,901	83,447,901	12,622	12,622
第9期計算期間末	(2021年11月10日)	104,137,823	104,137,823	13,229	13,229
第10期計算期間末	(2022年 5月10日)	120,808,258	120,808,258	12,852	12,852
第11期計算期間末	(2022年11月10日)	146,235,732	146,235,732	13,177	13,177
	2021年11月末日	104,770,644		12,974	
	12月末日	111,172,127		13,341	
	2022年 1月末日	110,689,691		12,823	
	2月末日	111,864,504		12,679	
	3月末日	122,279,991		13,389	
	4月末日	123,597,489		13,230	
	5月末日	126,989,216		13,166	
	6月末日	130,222,821		13,112	
	7月末日	135,451,631		13,319	
	8月末日	139,828,142		13,396	
	9月末日	137,303,245		12,783	
	10月末日	146,645,018		13,245	
	11月末日	150,087,023		13,226	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	0
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	0

第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	0
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	0
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	0
第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	0
第9期計算期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	0
第10期計算期間	2021年11月11日～2022年 5月10日	0
第11期計算期間	2022年 5月11日～2022年11月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2017年11月10日	4.3
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	0.1
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	0.7
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	1.2
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	6.7
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	11.6
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	11.9
第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	14.1
第9期計算期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	4.8
第10期計算期間	2021年11月11日～2022年 5月10日	2.8
第11期計算期間	2022年 5月11日～2022年11月10日	2.5

(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	2017年 8月25日～2017年11月10日	3,291,330	120,520	3,170,810
第2期計算期間	2017年11月11日～2018年 5月10日	6,642,105	1,706,320	8,106,595
第3期計算期間	2018年 5月11日～2018年11月12日	6,807,776	1,183,554	13,730,817
第4期計算期間	2018年11月13日～2019年 5月10日	9,998,798	1,308,700	22,420,915
第5期計算期間	2019年 5月11日～2019年11月11日	10,577,572	4,052,049	28,946,438
第6期計算期間	2019年11月12日～2020年 5月11日	15,251,653	4,770,851	39,427,240
第7期計算期間	2020年 5月12日～2020年11月10日	16,057,478	2,841,160	52,643,558
第8期計算期間	2020年11月11日～2021年 5月10日	17,379,718	3,908,644	66,114,632
第9期計算期間	2021年 5月11日～2021年11月10日	18,347,554	5,742,323	78,719,863
第10期計算期間	2021年11月11日～2022年 5月10日	18,905,302	3,627,643	93,997,522
第11期計算期間	2022年 5月11日～2022年11月10日	19,710,030	2,730,312	110,977,240

(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。

#### 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。

## 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	MEDIATEK 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。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.95

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。

## 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。

#### ロ.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-REITインデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	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	アクティブ・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	MP 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。

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2017年8月25日  
作成基準日：2022年11月30日



### 基準価額・純資産の推移



基準価額 13,226円  
純資産総額 1.50億円

### 分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2020年11月	0円
2021年5月	0円
2021年11月	0円
2022年5月	0円
2022年11月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内株式インデックスマザーファンド	13.2%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.5%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.4%
外国株式インデックスマザーファンド	12.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア	-	-	0.6%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.4%
新興国債券インデックスマザーファンド	12.8%	BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.4%
		COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.3%
J-REITインデックスマザーファンド	12.5%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.8%
		ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.7%
外国債券インデックスマザーファンド	12.3%	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	国債	-	1.375%	2031/11/15	0.1%
		T 1.25% 09/30/28	アメリカ	国債	-	1.250%	2028/09/30	0.1%
新興国株式インデックスマザーファンド	12.1%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.7%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.4%
グローバルREITインデックスマザーファンド	12.0%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	1.0%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
国内債券インデックスマザーファンド	11.2%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.1%
		第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/12/20	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）



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

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク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。（2017年 8月25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5月11日から11月10日まで及び11月11日から翌年5月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年8月25日から2017年11月10日までとします。

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

## （５）【その他】

### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

#### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

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

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

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

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づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当するものを除きます。）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。

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

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

## < 運用報告書 >

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

## < 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益

権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、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11期計算期間(2022年5月11日から2022年11月10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 8資産インデックスバランス・オープン】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (2022年5月10日現在)	第11期 (2022年11月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,638,565	1,825,204
親投資信託受益証券	119,564,931	144,790,314
流動資産合計	121,203,496	146,615,518
資産合計	121,203,496	146,615,518
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	83,268	1,468
未払受託者報酬	30,900	37,467
未払委託者報酬	278,048	337,158
未払利息	-	4
その他未払費用	3,022	3,689
流動負債合計	395,238	379,786
負債合計	395,238	379,786
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	93,997,522	110,977,240
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	26,810,736	35,258,492
(分配準備積立金)	15,581,461	16,996,033
元本等合計	120,808,258	146,235,732
純資産合計	120,808,258	146,235,732
負債純資産合計	121,203,496	146,615,518

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期		第11期	
	自	2021年11月11日	自	2022年 5月11日
	至	2022年 5月10日	至	2022年11月10日
営業収益				
受取利息		2		2
有価証券売買等損益		2,913,855		3,521,366
営業収益合計		2,913,853		3,521,368
営業費用				
支払利息		138		282
受託者報酬		30,900		37,467
委託者報酬		278,048		337,158
その他費用		3,022		3,689
営業費用合計		312,108		378,596
営業利益又は営業損失（ ）		3,225,961		3,142,772
経常利益又は経常損失（ ）		3,225,961		3,142,772
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,225,961		3,142,772
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（ ）		37,896		76,906
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		25,417,960		26,810,736
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,740,740		6,165,448
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,740,740		6,165,448
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,159,899		783,558
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,159,899		783,558
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		26,810,736		35,258,492

## (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10期 (2022年 5月10日現在)	第11期 (2022年11月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	93,997,522口	110,977,240口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2852円 (12,852円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3177円 (13,177円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 2021年11月11日 至 2022年 5月10日	第11期 自 2022年 5月11日 至 2022年11月10日																																																												
<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,138,465円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>16,318,471円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>14,442,996円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>31,899,932円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>93,997,522口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>3,393円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,138,465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	16,318,471円	分配準備積立金額	D	14,442,996円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	31,899,932円	当ファンドの期末残存口数	F	93,997,522口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,393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	<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,816,008円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>22,513,522円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>15,180,025円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>39,509,555円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>110,977,240口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>3,560円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,816,008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	22,513,522円	分配準備積立金額	D	15,180,025円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	39,509,555円	当ファンドの期末残存口数	F	110,977,240口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,560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
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,138,465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	16,318,471円																																																											
分配準備積立金額	D	14,442,996円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	31,899,932円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	93,997,522口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,393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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,816,008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	22,513,522円																																																											
分配準備積立金額	D	15,180,025円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	39,509,555円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	110,977,240口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,560円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第11期 自 2022年 5月11日 至 2022年11月10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11期 (2022年11月10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10期	第11期
	自 2021年11月11日 至 2022年 5月10日	自 2022年 5月11日 至 2022年11月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	78,719,863円	93,997,522円
期中追加設定元本額	18,905,302円	19,710,030円
期中一部解約元本額	3,627,643円	2,730,312円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第10期 (2022年 5月10日現在)	第11期 (2022年11月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,629,572	3,509,471
合計	3,629,572	3,509,471

（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	8,445,182	18,130,961	
	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	7,192,112	17,555,226	
	新興国株式インデックス マザーファンド	5,055,170	17,653,664	

国内株式インデックス マザーファンド	9,732,741	18,847,452
外国株式インデックス マザーファンド	4,307,762	18,780,119
国内債券インデックス マザーファンド	12,171,756	16,493,946
外国債券インデックス マザーファンド	5,774,044	18,289,861
新興国債券インデックス マザーファンド	10,291,954	19,039,085
合計	62,970,721	144,790,314

(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11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,333,817,132
株式	497,848,364,840
派生商品評価勘定	251,833,250
未収入金	2,145,700
未収配当金	5,218,352,621
差入委託証拠金	222,871,000
流動資産合計	504,877,384,543
資産合計	504,877,384,543
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	354,950
前受金	251,502,500
未払解約金	371,094,775
未払利息	3,011
流動負債合計	622,955,236
負債合計	622,955,236
純資産の部	
元本等	
元本	260,389,959,961
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	243,864,469,346

	2022年11月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	504,254,429,307
純資産合計	504,254,429,307
負債純資産合計	504,877,384,543

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年11月10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11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	260,389,959,961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 1.9365円 (1万口当たり純資産額) (19,365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11月10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11月10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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月11日
期首元本額	260,787,797,765円
期中追加設定元本額	12,767,093,262円
期中一部解約元本額	13,164,931,066円
期末元本額	260,389,959,961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）	391,445,041円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,062,564,490円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,524,116円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,731,580,050円
世界経済インデックスファンド	4,330,908,523円
日本株式インデックス・オープン	3,245,564,695円
DCマイセレクション25	6,163,066,602円
DCマイセレクション50	19,039,016,382円
DCマイセレクション75	19,360,455,363円
DC日本株式インデックス・オープン	6,236,266,738円
DCマイセレクションS25	3,224,938,831円
DCマイセレクションS50	9,529,728,825円
DCマイセレクションS75	7,392,693,317円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,609,857,636円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	159,491,260円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	683,190,126円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	512,359,612円
DC世界経済インデックスファンド	3,812,325,693円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,484,562,672円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	4,070,662円
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

区分	2022年11月10日現在
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	170,695,896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）	100,517,813円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	24,636,469円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	67,888,060円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	807,332,015円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	418,611,935円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,710,436,473円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	41,231,675円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	17,430,090円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	454,203,077円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	253,777,864円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	332,702,868円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	34,140,989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）	579,216,833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	1,995,847,187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	1,561,018,872円
分散投資コア戦略ファンドS	6,384,583,887円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	523,000,430円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	446,657,225円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,763,584,536円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	223,565,245円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,961,848円
SMT インデックスバランス・オープン	58,028,210円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	27,396,693,431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	52,825,549円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	200,268,636円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,101,402円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,732,741円
グローバル経済コア	221,896,752円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	29,962,909円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	239,613,794円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,256,398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	20,297,983円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	17,764,973円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	6,960,782円

区分	2022年11月10日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	8,527,701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)	44,584,736,856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)	796,588,219円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	329,766,929円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	54,578,728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)	45,715,608,856円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	18,763,676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)	212,769,431円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		3,950,245,323
合計		3,950,245,323

(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11月10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	5,668,067,500	-	5,919,570,000	251,502,500
	合計	5,668,067,500	-	5,919,570,000	251,502,500

## (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	9,500	3,685.00	35,007,500	
日本水産	249,500	504.00	125,748,000	
マルハニチロ	38,600	2,453.00	94,685,800	
雪国まいたけ	21,300	1,064.00	22,663,200	
カネコ種苗	8,200	1,420.00	11,644,000	
サカタのタネ	31,600	4,890.00	154,524,000	
ホクト	22,200	1,913.00	42,468,600	
ホクリヨウ	3,500	627.00	2,194,500	
住石ホールディングス	38,700	199.00	7,701,300	
日鉄鉱業	10,000	3,020.00	30,200,000	
三井松島ホールディングス	11,300	2,678.00	30,261,400	
I N P E X	923,000	1,561.00	1,440,803,000	
石油資源開発	28,900	4,190.00	121,091,000	
K & O エナジーグループ	11,300	2,236.00	25,266,800	
ショーボンドホールディングス	34,000	6,440.00	218,960,000	
ミライト・ワン	86,500	1,446.00	125,079,000	
タマホーム	17,600	2,344.00	41,254,400	
サンヨーホームズ	3,000	693.00	2,079,000	
日本アクア	10,400	748.00	7,779,200	
ファーストコーポレーション	6,400	721.00	4,614,400	
ベステラ	5,400	988.00	5,335,200	
R o b o t H o m e	42,500	175.00	7,437,500	
キャンディル	3,800	491.00	1,865,800	
ダイセキ環境ソリューション	5,000	786.00	3,930,000	
第一カッター興業	6,400	1,196.00	7,654,400	
安藤・間	144,600	874.00	126,380,400	
東急建設	71,100	646.00	45,930,600	
コムシスホールディングス	84,500	2,448.00	206,856,000	
ビーアールホールディングス	39,600	345.00	13,662,000	
高松コンストラクショングループ	16,300	1,949.00	31,768,700	
東建コーポレーション	8,100	7,760.00	62,856,000	
ソネック	2,700	918.00	2,478,600	
ヤマウラ	12,600	985.00	12,411,000	
オリエンタル白石	89,700	272.00	24,398,400	
大成建設	173,800	4,175.00	725,615,000	
大林組	624,300	1,012.00	631,791,600	
清水建設	524,800	747.00	392,025,600	
飛鳥建設	19,300	1,044.00	20,149,200	
長谷工コーポレーション	180,200	1,572.00	283,274,400	
松井建設	19,600	555.00	10,878,000	



銭高組	2,200	2,910.00	6,402,000
鹿島建設	387,100	1,517.00	587,230,700
不動テトラ	12,600	1,485.00	18,711,000
大末建設	6,300	1,197.00	7,541,100
鉄建建設	12,500	1,746.00	21,825,000
西松建設	29,600	3,730.00	110,408,000
三井住友建設	140,800	404.00	56,883,200
大豊建設	7,200	4,170.00	30,024,000
佐田建設	11,100	435.00	4,828,500
ナカノフドー建設	12,400	307.00	3,806,800
奥村組	28,300	2,845.00	80,513,500
東鉄工業	24,000	2,523.00	60,552,000
イチケン	3,900	1,766.00	6,887,400
富士ピー・エス	7,800	434.00	3,385,200
浅沼組	14,000	2,833.00	39,662,000
戸田建設	214,800	719.00	154,441,200
熊谷組	30,200	2,555.00	77,161,000
北野建設	3,300	2,469.00	8,147,700
植木組	4,900	1,229.00	6,022,100
矢作建設工業	24,500	717.00	17,566,500
ピーエス三菱	22,100	592.00	13,083,200
日本ハウスホールディングス	34,600	420.00	14,532,000
新日本建設	24,500	729.00	17,860,500
東亜道路工業	3,500	6,030.00	21,105,000
日本道路	3,500	6,100.00	21,350,000
東亜建設工業	15,000	2,408.00	36,120,000
日本国土開発	52,300	582.00	30,438,600
若築建設	8,700	2,483.00	21,602,100
東洋建設	56,500	855.00	48,307,500
五洋建設	247,500	650.00	160,875,000
世紀東急工業	26,800	780.00	20,904,000
福田組	6,600	4,705.00	31,053,000
住友林業	133,900	2,260.00	302,614,000
日本基礎技術	11,100	407.00	4,517,700
巴コーポレーション	19,500	357.00	6,961,500
大和ハウス工業	487,800	3,065.00	1,495,107,000
ライト工業	33,200	2,113.00	70,151,600
積水ハウス	546,900	2,486.00	1,359,593,400
日特建設	16,700	910.00	15,197,000
北陸電気工事	12,000	665.00	7,980,000
ユアテック	38,500	719.00	27,681,500
日本リーテック	11,700	723.00	8,459,100

四電工	7,300	1,711.00	12,490,300
中電工	27,100	2,063.00	55,907,300
関電工	95,600	865.00	82,694,000
きんでん	122,900	1,454.00	178,696,600
東京エネシス	17,500	931.00	16,292,500
トーエネック	6,100	3,395.00	20,709,500
住友電設	16,600	2,492.00	41,367,200
日本電設工業	28,700	1,633.00	46,867,100
エクシオグループ	85,500	2,145.00	183,397,500
新日本空調	9,700	1,919.00	18,614,300
九電工	42,500	3,350.00	142,375,000
三機工業	38,700	1,584.00	61,300,800
日揮ホールディングス	172,700	1,880.00	324,676,000
中外炉工業	5,700	1,564.00	8,914,800
ヤマト	14,500	667.00	9,671,500
太平電業	11,000	3,230.00	35,530,000
高砂熱学工業	42,100	1,819.00	76,579,900
三晃金属工業	2,100	2,924.00	6,140,400
朝日工業社	7,200	1,972.00	14,198,400
明星工業	30,000	727.00	21,810,000
大気社	21,000	3,510.00	73,710,000
ダイダン	11,500	2,082.00	23,943,000
日比谷総合設備	16,000	1,867.00	29,872,000
フィル・カンパニー	3,100	1,055.00	3,270,500
テスホールディングス	18,800	1,017.00	19,119,600
インフロニア・ホールディングス	182,900	1,004.00	183,631,600
東洋エンジニアリング	23,800	583.00	13,875,400
レイズネクスト	26,300	1,253.00	32,953,900
ニッポン	47,200	1,580.00	74,576,000
日清製粉グループ本社	162,100	1,594.00	258,387,400
日東富士製粉	3,100	4,360.00	13,516,000
昭和産業	15,300	2,533.00	38,754,900
鳥越製粉	14,000	622.00	8,708,000
中部飼料	24,300	1,037.00	25,199,100
フィード・ワン	25,600	685.00	17,536,000
東洋精糖	3,300	874.00	2,884,200
日本甜菜製糖	10,400	1,617.00	16,816,800
D M三井製糖ホールディングス	17,400	1,946.00	33,860,400
塩水港精糖	20,900	196.00	4,096,400
日新製糖	9,300	1,667.00	15,503,100
森永製菓	36,100	3,695.00	133,389,500
中村屋	4,400	3,075.00	13,530,000

江崎グリコ	50,100	3,550.00	177,855,000
名糖産業	6,900	1,566.00	10,805,400
井村屋グループ	9,600	2,239.00	21,494,400
不二家	12,000	2,635.00	31,620,000
山崎製パン	117,300	1,527.00	179,117,100
第一屋製パン	3,300	403.00	1,329,900
モロゾフ	5,700	3,585.00	20,434,500
亀田製菓	11,100	4,210.00	46,731,000
寿スピリッツ	18,600	7,380.00	137,268,000
カルビー	80,200	2,859.00	229,291,800
森永乳業	31,800	4,415.00	140,397,000
六甲バター	12,900	1,346.00	17,363,400
ヤクルト本社	125,200	8,280.00	1,036,656,000
明治ホールディングス	108,600	6,500.00	705,900,000
雪印メグミルク	42,400	1,717.00	72,800,800
プリマハム	23,500	1,967.00	46,224,500
日本ハム	68,500	3,635.00	248,997,500
林兼産業	5,300	470.00	2,491,000
丸大食品	17,600	1,401.00	24,657,600
S Foods	19,300	2,788.00	53,808,400
柿安本店	6,800	2,184.00	14,851,200
伊藤ハム米久ホールディングス	136,200	684.00	93,160,800
サッポロホールディングス	57,700	3,680.00	212,336,000
アサヒグループホールディングス	405,000	4,273.00	1,730,565,000
キリンホールディングス	790,900	2,209.00	1,747,098,100
宝ホールディングス	119,600	1,016.00	121,513,600
オエノンホールディングス	52,400	266.00	13,938,400
養命酒製造	5,800	1,788.00	10,370,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	137,300	1,359.00	186,590,700
サントリー食品インターナショナル	123,400	5,220.00	644,148,000
ダイドーグループホールディングス	9,900	4,555.00	45,094,500
伊藤園	65,300	5,280.00	344,784,000
キーコーヒー	19,600	2,081.00	40,787,600
ユニカフェ	5,800	944.00	5,475,200
ジャパンフーズ	2,700	1,050.00	2,835,000
日清オイリオグループ	24,700	3,400.00	83,980,000
不二製油グループ本社	40,800	2,060.00	84,048,000
かどや製油	1,800	3,490.00	6,282,000
J - オイルミルズ	18,100	1,530.00	27,693,000
キッコーマン	116,100	7,850.00	911,385,000
味の素	428,900	4,100.00	1,758,490,000
ブルドックソース	7,000	1,671.00	11,697,000

キュービー	94,200	2,418.00	227,775,600
ハウス食品グループ本社	53,600	2,722.00	145,899,200
カゴメ	81,700	2,956.00	241,505,200
焼津水産化学工業	7,800	799.00	6,232,200
アリアケジャパン	15,300	5,400.00	82,620,000
ピエトロ	2,500	1,796.00	4,490,000
エバラ食品工業	4,700	3,125.00	14,687,500
やまみ	1,700	1,313.00	2,232,100
ニチレイ	80,300	2,619.00	210,305,700
東洋水産	88,600	5,980.00	529,828,000
イトアンドホールディングス	7,400	2,196.00	16,250,400
大冷	2,200	1,884.00	4,144,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,100	487.00	5,405,700
日清食品ホールディングス	62,400	10,100.00	630,240,000
永谷園ホールディングス	8,800	2,009.00	17,679,200
一正蒲鉾	7,500	749.00	5,617,500
フジッコ	18,000	1,928.00	34,704,000
ロック・フィールド	21,400	1,453.00	31,094,200
日本たばこ産業	1,153,700	2,817.00	3,249,972,900
ケンコーマヨネーズ	12,100	1,622.00	19,626,200
わらべや日洋ホールディングス	12,900	1,811.00	23,361,900
なとり	11,200	2,031.00	22,747,200
イフジ産業	3,000	893.00	2,679,000
ファーマフーズ	27,100	1,252.00	33,929,200
ユーグレナ	112,800	882.00	99,489,600
紀文食品	14,000	905.00	12,670,000
ピクルスホールディングス	10,300	1,073.00	11,051,900
ミヨシ油脂	6,200	986.00	6,113,200
理研ビタミン	15,100	1,886.00	28,478,600
片倉工業	16,700	2,007.00	33,516,900
ゲンゼ	13,500	3,810.00	51,435,000
東洋紡	77,600	1,035.00	80,316,000
ユニチカ	55,800	247.00	13,782,600
富士紡ホールディングス	7,700	3,285.00	25,294,500
倉敷紡績	13,600	2,089.00	28,410,400
シキボウ	9,900	861.00	8,523,900
日本毛織	52,400	995.00	52,138,000
トーア紡コーポレーション	6,900	351.00	2,421,900
帝国繊維	20,400	1,570.00	32,028,000
帝人	171,700	1,242.00	213,251,400
東レ	1,195,300	722.30	863,365,190
住江織物	3,200	1,802.00	5,766,400

日本フェルト	11,200	395.00	4,424,000
イチカワ	2,600	1,295.00	3,367,000
日東製網	2,000	1,326.00	2,652,000
アツギ	10,900	356.00	3,880,400
ダイニック	4,600	612.00	2,815,200
セーレン	34,700	2,335.00	81,024,500
ソトー	5,900	777.00	4,584,300
東海染工	2,200	1,124.00	2,472,800
小松マテーレ	28,000	784.00	21,952,000
ワコールホールディングス	34,400	2,425.00	83,420,000
ホギメディカル	24,000	3,330.00	79,920,000
T S Iホールディングス	64,200	465.00	29,853,000
マツオカコーポレーション	5,000	936.00	4,680,000
ワールド	23,400	1,295.00	30,303,000
三陽商会	6,800	1,153.00	7,840,400
ナイガイ	6,700	263.00	1,762,100
オンワードホールディングス	116,300	304.00	35,355,200
ルックホールディングス	5,200	2,110.00	10,972,000
ゴールドウイン	31,600	8,130.00	256,908,000
デサント	30,800	3,350.00	103,180,000
キング	8,200	486.00	3,985,200
ヤマトインターナショナル	14,900	237.00	3,531,300
特種東海製紙	9,500	2,958.00	28,101,000
王子ホールディングス	742,700	537.00	398,829,900
日本製紙	92,900	937.00	87,047,300
三菱製紙	21,400	280.00	5,992,000
北越コーポレーション	112,900	839.00	94,723,100
中越パルプ工業	7,200	927.00	6,674,400
巴川製紙所	5,600	781.00	4,373,600
大王製紙	78,700	1,100.00	86,570,000
阿波製紙	4,300	303.00	1,302,900
レンゴー	162,400	875.00	142,100,000
トーモク	10,300	1,622.00	16,706,600
ザ・パック	13,200	2,460.00	32,472,000
北の達人コーポレーション	75,100	277.00	20,802,700
クラレ	283,400	1,050.00	297,570,000
旭化成	1,113,400	962.30	1,071,424,820
共和レザー	10,200	491.00	5,008,200
昭和電工	172,300	2,154.00	371,134,200
住友化学	1,322,600	475.00	628,235,000
住友精化	7,400	3,760.00	27,824,000
日産化学	84,600	6,450.00	545,670,000

ラサ工業	6,900	2,344.00	16,173,600
クレハ	15,200	9,800.00	148,960,000
多木化学	6,900	5,110.00	35,259,000
テイカ	12,000	1,306.00	15,672,000
石原産業	32,300	1,013.00	32,719,900
片倉コープアグリ	3,600	1,214.00	4,370,400
日本曹達	19,100	4,265.00	81,461,500
東ソー	238,000	1,541.00	366,758,000
トクヤマ	57,600	1,779.00	102,470,400
セントラル硝子	28,600	3,735.00	106,821,000
東亜合成	91,700	1,158.00	106,188,600
大阪ソーダ	10,700	3,990.00	42,693,000
関東電化工業	34,500	972.00	33,534,000
デンカ	64,800	3,375.00	218,700,000
信越化学工業	305,100	15,995.00	4,880,074,500
日本カーバイド工業	6,700	1,250.00	8,375,000
堺化学工業	13,600	1,880.00	25,568,000
第一稀元素化学工業	16,200	1,249.00	20,233,800
エア・ウォーター	168,200	1,609.00	270,633,800
日本酸素ホールディングス	173,000	2,176.00	376,448,000
日本化学工業	5,900	1,873.00	11,050,700
東邦アセチレン	3,800	1,103.00	4,191,400
日本パーカラライジング	88,300	966.00	85,297,800
高压ガス工業	27,000	648.00	17,496,000
チタン工業	2,200	1,682.00	3,700,400
四国化成工業	21,200	1,320.00	27,984,000
戸田工業	4,100	3,100.00	12,710,000
ステラ ケミファ	10,600	2,614.00	27,708,400
保土谷化学工業	5,000	2,969.00	14,845,000
日本触媒	27,200	5,410.00	147,152,000
大日精化工業	13,200	1,776.00	23,443,200
カネカ	40,700	3,395.00	138,176,500
三菱瓦斯化学	133,100	1,883.00	250,627,300
三井化学	149,900	3,000.00	449,700,000
J S R	166,500	2,616.00	435,564,000
東京応化工業	31,200	6,550.00	204,360,000
大阪有機化学工業	13,400	2,024.00	27,121,600
三菱ケミカルグループ	1,203,100	699.40	841,448,140
K Hネオケム	29,700	2,659.00	78,972,300
ダイセル	262,100	970.00	254,237,000
住友ベークライト	26,400	4,100.00	108,240,000
積水化学工業	370,200	1,899.00	703,009,800

日本ゼオン	106,900	1,336.00	142,818,400
アイカ工業	45,000	3,210.00	144,450,000
UBE	91,900	1,938.00	178,102,200
積水樹脂	25,900	1,712.00	44,340,800
タキロンシーアイ	40,400	507.00	20,482,800
旭有機材	11,900	2,658.00	31,630,200
ニチバン	11,000	1,743.00	19,173,000
リケンテクノス	38,400	494.00	18,969,600
大倉工業	8,300	1,859.00	15,429,700
積水化成成品工業	25,000	389.00	9,725,000
群栄化学工業	4,200	2,401.00	10,084,200
タイガースポリマー	8,100	388.00	3,142,800
ミライアル	5,400	1,628.00	8,791,200
ダイキアクシス	6,500	708.00	4,602,000
ダイキョーニシカワ	39,300	611.00	24,012,300
竹本容器	6,000	731.00	4,386,000
森六ホールディングス	9,000	1,711.00	15,399,000
恵和	5,800	3,555.00	20,619,000
日本化薬	136,200	1,188.00	161,805,600
カーリットホールディングス	16,000	666.00	10,656,000
日本精化	10,100	2,197.00	22,189,700
扶桑化学工業	16,500	3,360.00	55,440,000
トリケミカル研究所	23,800	2,239.00	53,288,200
ADEKA	62,200	2,203.00	137,026,600
日油	55,100	5,440.00	299,744,000
新日本理化	24,500	266.00	6,517,000
ハリマ化成グループ	12,500	814.00	10,175,000
花王	434,100	5,337.00	2,316,791,700
第一工業製薬	6,400	1,873.00	11,987,200
石原ケミカル	8,800	1,227.00	10,797,600
日華化学	7,100	867.00	6,155,700
ニイタカ	3,600	2,085.00	7,506,000
三洋化成工業	11,000	4,290.00	47,190,000
有機合成薬品工業	13,100	299.00	3,916,900
大日本塗料	21,800	750.00	16,350,000
日本ペイントホールディングス	788,900	967.00	762,866,300
関西ペイント	163,300	1,819.00	297,042,700
神東塗料	14,800	130.00	1,924,000
中国塗料	33,000	1,035.00	34,155,000
日本特殊塗料	11,300	846.00	9,559,800
藤倉化成	24,000	396.00	9,504,000
太陽ホールディングス	27,100	2,467.00	66,855,700

D I C	69,700	2,524.00	175,922,800
サカタインクス	39,700	1,056.00	41,923,200
東洋インキＳＣホールディングス	34,900	1,903.00	66,414,700
T & K T O K A	15,800	889.00	14,046,200
富士フイルムホールディングス	342,500	6,795.00	2,327,287,500
資生堂	372,700	5,083.00	1,894,434,100
ライオン	214,200	1,438.00	308,019,600
高砂香料工業	12,100	2,850.00	34,485,000
マンダム	38,600	1,339.00	51,685,400
ミルボン	26,500	6,110.00	161,915,000
ファンケル	78,100	2,550.00	199,155,000
コーセー	36,300	15,030.00	545,589,000
コタ	14,900	1,616.00	24,078,400
シーボン	2,300	1,581.00	3,636,300
ポーラ・オルビスホールディングス	91,500	1,633.00	149,419,500
ノエビアホールディングス	15,900	5,440.00	86,496,000
アジュバンホールディングス	4,300	914.00	3,930,200
新日本製薬	10,200	1,531.00	15,616,200
エステー	13,800	1,531.00	21,127,800
アグロ カネショウ	7,100	1,351.00	9,592,100
コニシ	29,800	1,778.00	52,984,400
長谷川香料	37,000	3,230.00	119,510,000
星光P M C	9,100	543.00	4,941,300
小林製薬	54,600	8,200.00	447,720,000
荒川化学工業	15,100	926.00	13,982,600
メック	14,700	2,506.00	36,838,200
日本高純度化学	4,600	2,322.00	10,681,200
タカラバイオ	48,100	1,756.00	84,463,600
J C U	20,200	3,245.00	65,549,000
新田ゼラチン	11,000	944.00	10,384,000
O A T アグリオ	7,300	1,584.00	11,563,200
デクセリアルズ	51,500	3,150.00	162,225,000
アース製薬	16,200	5,300.00	85,860,000
北興化学工業	18,000	907.00	16,326,000
大成ラミック	5,600	2,954.00	16,542,400
クミアイ化学工業	70,900	962.00	68,205,800
日本農薬	32,700	761.00	24,884,700
アキレス	12,500	1,382.00	17,275,000
有沢製作所	29,200	1,245.00	36,354,000
日東電工	129,600	8,250.00	1,069,200,000
レック	25,400	833.00	21,158,200
三光合成	24,500	467.00	11,441,500



きもと	26,200	234.00	6,130,800
藤森工業	14,600	3,100.00	45,260,000
前澤化成工業	11,500	1,373.00	15,789,500
未来工業	7,000	1,464.00	10,248,000
ウェブロックホールディングス	5,300	590.00	3,127,000
J S P	12,500	1,465.00	18,312,500
エフピコ	33,800	3,705.00	125,229,000
天馬	15,400	2,036.00	31,354,400
信越ポリマー	33,000	1,231.00	40,623,000
東リ	39,900	200.00	7,980,000
ニフコ	64,400	3,445.00	221,858,000
バルカー	14,900	2,664.00	39,693,600
ユニ・チャーム	371,900	4,964.00	1,846,111,600
ショーエイコーポレーション	5,200	566.00	2,943,200
協和キリン	215,700	3,130.00	675,141,000
武田薬品工業	1,579,800	3,896.00	6,154,900,800
アステラス製薬	1,710,700	2,068.50	3,538,582,950
住友ファーマ	132,400	1,005.00	133,062,000
塩野義製薬	228,100	6,625.00	1,511,162,500
わかもと製薬	16,700	222.00	3,707,400
日本新薬	42,100	7,920.00	333,432,000
中外製薬	558,800	3,359.00	1,877,009,200
科研製薬	30,600	3,760.00	115,056,000
エーザイ	217,100	8,494.00	1,844,047,400
ロート製薬	86,500	4,560.00	394,440,000
小野薬品工業	344,400	3,390.00	1,167,516,000
久光製薬	39,700	3,600.00	142,920,000
持田製薬	21,400	3,155.00	67,517,000
参天製薬	346,700	1,026.00	355,714,200
扶桑薬品工業	6,300	2,027.00	12,770,100
日本ケミファ	1,800	1,686.00	3,034,800
ツムラ	56,200	2,962.00	166,464,400
日医工	52,100	282.00	14,692,200
キッセイ薬品工業	27,600	2,426.00	66,957,600
生化学工業	34,000	904.00	30,736,000
栄研化学	29,000	1,859.00	53,911,000
鳥居薬品	9,600	2,881.00	27,657,600
J C R ファーマ	60,400	1,855.00	112,042,000
東和薬品	27,400	2,191.00	60,033,400
富士製薬工業	11,500	1,078.00	12,397,000
ゼリア新薬工業	24,700	2,193.00	54,167,100
第一三共	1,555,100	4,610.00	7,169,011,000

キョーリン製薬ホールディングス	38,700	1,742.00	67,415,400
大幸薬品	32,300	525.00	16,957,500
ダイト	13,400	2,508.00	33,607,200
大塚ホールディングス	408,400	4,562.00	1,863,120,800
大正製薬ホールディングス	39,700	5,370.00	213,189,000
ペプチドリーム	86,500	1,503.00	130,009,500
あすか製薬ホールディングス	18,300	1,123.00	20,550,900
サワイグループホールディングス	40,800	4,065.00	165,852,000
日本コークス工業	161,000	84.00	13,524,000
ニチレキ	21,100	1,248.00	26,332,800
ユシロ化学工業	9,300	794.00	7,384,200
ビーピー・カストロール	6,900	913.00	6,299,700
富士石油	36,400	301.00	10,956,400
MORESCO	5,800	1,045.00	6,061,000
出光興産	198,300	3,240.00	642,492,000
ENEOSホールディングス	3,225,100	488.30	1,574,816,330
コスモエネルギーホールディングス	67,700	3,725.00	252,182,500
横浜ゴム	101,600	2,167.00	220,167,200
TOYO TIRE	102,600	1,625.00	166,725,000
ブリヂストン	570,000	5,173.00	2,948,610,000
住友ゴム工業	175,100	1,103.00	193,135,300
藤倉コンポジット	12,600	802.00	10,105,200
オカモト	9,900	3,730.00	36,927,000
フコク	9,400	1,036.00	9,738,400
ニッタ	18,100	2,904.00	52,562,400
住友理工	36,200	600.00	21,720,000
三ツ星ベルト	26,000	3,380.00	87,880,000
バンドー化学	30,300	999.00	30,269,700
日東紡績	21,300	2,080.00	44,304,000
A G C	181,700	4,420.00	803,114,000
日本板硝子	91,000	568.00	51,688,000
石塚硝子	2,800	1,452.00	4,065,600
日本山村硝子	6,800	576.00	3,916,800
日本電気硝子	72,900	2,507.00	182,760,300
オハラ	8,500	1,233.00	10,480,500
住友大阪セメント	25,200	3,165.00	79,758,000
太平洋セメント	113,700	2,045.00	232,516,500
日本ヒューム	16,100	613.00	9,869,300
日本コンクリート工業	35,100	236.00	8,283,600
三谷セキサン	7,800	3,785.00	29,523,000
アジアパイルホールディングス	28,100	495.00	13,909,500
東海カーボン	149,800	1,050.00	157,290,000

日本カーボン	10,300	4,325.00	44,547,500
東洋炭素	11,200	3,770.00	42,224,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,900	3,990.00	35,511,000
TOTO	117,800	4,215.00	496,527,000
日本碍子	211,300	1,741.00	367,873,300
日本特殊陶業	135,900	2,664.00	362,037,600
MARUWA	6,600	17,710.00	116,886,000
品川リフラクトリーズ	5,000	4,015.00	20,075,000
黒崎播磨	3,700	4,885.00	18,074,500
ヨータイ	12,300	1,400.00	17,220,000
東京窯業	16,700	267.00	4,458,900
ニッカトー	8,200	464.00	3,804,800
フジミインコーポレーテッド	14,200	6,280.00	89,176,000
クニミネ工業	5,300	800.00	4,240,000
エーアンドエーマテリアル	3,400	857.00	2,913,800
ニチアス	45,200	2,392.00	108,118,400
ニチハ	22,400	2,821.00	63,190,400
日本製鉄	822,300	2,174.00	1,787,680,200
神戸製鋼所	369,400	601.00	222,009,400
中山製鋼所	37,900	685.00	25,961,500
合同製鐵	9,200	1,865.00	17,158,000
JFEホールディングス	490,800	1,478.00	725,402,400
東京製鐵	51,700	1,321.00	68,295,700
共英製鋼	21,000	1,300.00	27,300,000
大和工業	30,300	4,735.00	143,470,500
東京鐵鋼	8,800	1,399.00	12,311,200
大阪製鐵	8,500	1,107.00	9,409,500
淀川製鋼所	21,000	2,493.00	52,353,000
丸一鋼管	55,900	2,786.00	155,737,400
モリ工業	4,200	2,771.00	11,638,200
大同特殊鋼	23,200	4,220.00	97,904,000
日本高周波鋼業	6,300	317.00	1,997,100
日本冶金工業	13,400	3,830.00	51,322,000
山陽特殊製鋼	18,200	2,174.00	39,566,800
愛知製鋼	10,600	2,316.00	24,549,600
日本金属	4,000	955.00	3,820,000
大平洋金属	13,100	1,882.00	24,654,200
新日本電工	117,500	393.00	46,177,500
栗本鐵工所	8,800	1,804.00	15,875,200
虹技	2,300	893.00	2,053,900
三菱製鋼	11,600	972.00	11,275,200
日亜鋼業	18,800	234.00	4,399,200

日本精線	2,700	4,170.00	11,259,000
エンビプロ・ホールディングス	12,700	702.00	8,915,400
シンニッタン	20,000	219.00	4,380,000
新家工業	4,000	2,193.00	8,772,000
大紀アルミニウム工業所	26,200	1,273.00	33,352,600
日本軽金属ホールディングス	49,600	1,496.00	74,201,600
三井金属鉱業	53,500	3,120.00	166,920,000
東邦亜鉛	10,900	2,164.00	23,587,600
三菱マテリアル	122,600	2,072.00	254,027,200
住友金属鉱山	213,000	4,330.00	922,290,000
DOWAホールディングス	41,300	4,940.00	204,022,000
古河機械金属	28,300	1,328.00	37,582,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,000	4,460.00	120,420,000
東邦チタニウム	33,300	2,948.00	98,168,400
UACJ	25,800	2,046.00	52,786,800
CKサンエツ	4,500	4,230.00	19,035,000
古河電気工業	61,200	2,494.00	152,632,800
住友電気工業	634,200	1,574.50	998,547,900
フジクラ	197,100	1,065.00	209,911,500
昭和電線ホールディングス	20,600	1,640.00	33,784,000
東京特殊電線	2,500	3,215.00	8,037,500
タツタ電線	37,600	435.00	16,356,000
カナレ電気	2,900	1,465.00	4,248,500
平河ヒューテック	10,900	1,115.00	12,153,500
リョービ	19,700	1,209.00	23,817,300
アーレスティ	20,600	371.00	7,642,600
アサヒホールディングス	74,300	1,946.00	144,587,800
稲葉製作所	10,700	1,364.00	14,594,800
宮地エンジニアリンググループ	5,400	3,250.00	17,550,000
トーカロ	50,500	1,210.00	61,105,000
アルファC o	6,700	942.00	6,311,400
SUMCO	349,600	2,014.00	704,094,400
川田テクノロジーズ	4,300	3,580.00	15,394,000
RS Technologies	6,000	8,920.00	53,520,000
ジェイテックコーポレーション	2,500	1,461.00	3,652,500
信和	10,100	799.00	8,069,900
東洋製罐グループホールディングス	121,500	1,565.00	190,147,500
ホッカンホールディングス	9,900	1,311.00	12,978,900
コロナ	10,300	843.00	8,682,900
横河ブリッジホールディングス	24,300	1,892.00	45,975,600
駒井ハルテック	3,000	1,569.00	4,707,000
高田機工	1,500	2,349.00	3,523,500

三和ホールディングス	169,100	1,255.00	212,220,500
文化シャッター	52,900	1,106.00	58,507,400
三協立山	25,200	559.00	14,086,800
アルインコ	14,000	993.00	13,902,000
東洋シャッター	4,200	490.00	2,058,000
LIXIL	267,500	1,981.00	529,917,500
日本フィルコン	11,900	457.00	5,438,300
ノーリツ	27,000	1,506.00	40,662,000
長府製作所	18,500	1,940.00	35,890,000
リンナイ	33,300	9,890.00	329,337,000
ダイニチ工業	9,100	663.00	6,033,300
日東精工	26,600	515.00	13,699,000
三洋工業	2,100	1,681.00	3,530,100
岡部	29,500	706.00	20,827,000
ジーテクト	20,500	1,450.00	29,725,000
東プレ	32,400	1,208.00	39,139,200
高周波熱錬	30,000	675.00	20,250,000
東京製網	10,800	912.00	9,849,600
サンコール	16,300	664.00	10,823,200
モリテック スチール	13,500	323.00	4,360,500
パイオラックス	25,300	1,706.00	43,161,800
エイチワン	18,900	629.00	11,888,100
日本発條	162,500	822.00	133,575,000
中央発條	10,200	701.00	7,150,200
アドバネクス	2,200	1,056.00	2,323,200
立川ブラインド工業	8,300	1,101.00	9,138,300
三益半導体工業	16,500	2,421.00	39,946,500
日本ドライケミカル	4,400	1,510.00	6,644,000
日本製鋼所	49,600	3,060.00	151,776,000
三浦工業	75,100	3,080.00	231,308,000
タクマ	55,400	1,231.00	68,197,400
ツガミ	40,100	1,091.00	43,749,100
オークマ	18,000	4,990.00	89,820,000
芝浦機械	20,000	2,687.00	53,740,000
アマダ	287,000	1,062.00	304,794,000
アイダエンジニアリング	37,200	790.00	29,388,000
TAKISAWA	4,800	1,106.00	5,308,800
FUJI	78,200	2,074.00	162,186,800
牧野フライス製作所	19,900	4,555.00	90,644,500
オーエスジー	85,900	1,937.00	166,388,300
ダイジェット工業	2,000	801.00	1,602,000
旭ダイヤモンド工業	52,200	694.00	36,226,800

DMG森精機	109,100	1,715.00	187,106,500
ソディック	49,700	778.00	38,666,600
ディスコ	28,800	37,550.00	1,081,440,000
日東工器	9,200	1,522.00	14,002,400
日進工具	15,200	1,112.00	16,902,400
パンチ工業	15,300	410.00	6,273,000
富士ダイス	8,500	567.00	4,819,500
豊和工業	10,000	868.00	8,680,000
ニデックオーケーケー	7,200	869.00	6,256,800
東洋機械金属	12,600	532.00	6,703,200
津田駒工業	3,300	607.00	2,003,100
エンシュウ	4,000	747.00	2,988,000
島精機製作所	28,700	1,968.00	56,481,600
オプトラン	26,600	2,167.00	57,642,200
NCホールディングス	3,700	1,839.00	6,804,300
イワキポンプ	12,000	1,387.00	16,644,000
フリュー	18,900	1,157.00	21,867,300
ヤマシンフィルタ	43,100	499.00	21,506,900
日阪製作所	19,300	822.00	15,864,600
やまびこ	29,400	1,169.00	34,368,600
野村マイクロ・サイエンス	6,100	3,845.00	23,454,500
平田機工	8,600	4,355.00	37,453,000
ペガサスミシン製造	19,900	982.00	19,541,800
マルマエ	8,700	1,808.00	15,729,600
タツモ	9,900	1,641.00	16,245,900
ナブテスコ	112,900	3,085.00	348,296,500
三井海洋開発	22,600	1,649.00	37,267,400
レオン自動機	20,500	1,181.00	24,210,500
S M C	58,300	62,180.00	3,625,094,000
ホソカワミクロン	13,800	2,739.00	37,798,200
ユニオンツール	7,900	3,755.00	29,664,500
オイレス工業	25,200	1,460.00	36,792,000
日精エー・エス・ビー機械	8,200	3,985.00	32,677,000
サトーホールディングス	25,600	1,903.00	48,716,800
技研製作所	18,800	3,270.00	61,476,000
日本エアータック	9,200	1,102.00	10,138,400
カワタ	5,300	841.00	4,457,300
日精樹脂工業	13,500	960.00	12,960,000
オカダアイヨン	5,600	1,480.00	8,288,000
ワイエイシイホールディングス	7,700	1,357.00	10,448,900
小松製作所	842,400	3,085.00	2,598,804,000
住友重機械工業	106,400	2,916.00	310,262,400

日立建機	71,700	3,045.00	218,326,500
日工	26,900	615.00	16,543,500
巴工業	7,800	2,406.00	18,766,800
井関農機	17,000	1,226.00	20,842,000
TOWA	18,400	1,890.00	34,776,000
丸山製作所	3,100	1,475.00	4,572,500
北川鉄工所	7,700	1,279.00	9,848,300
ローツェ	9,400	7,760.00	72,944,000
タカキタ	5,500	450.00	2,475,000
クボタ	951,400	2,011.00	1,913,265,400
荏原実業	9,000	2,211.00	19,899,000
三菱化工機	5,900	2,080.00	12,272,000
月島機械	24,500	981.00	24,034,500
帝国電機製作所	13,700	2,003.00	27,441,100
新東工業	36,600	662.00	24,229,200
澁谷工業	16,900	2,546.00	43,027,400
アイチ コーポレーション	26,600	803.00	21,359,800
小森コーポレーション	42,100	835.00	35,153,500
鶴見製作所	13,800	2,119.00	29,242,200
住友精密工業	2,600	2,510.00	6,526,000
日本ギア工業	6,300	320.00	2,016,000
酒井重工業	2,900	3,085.00	8,946,500
荏原製作所	73,600	4,995.00	367,632,000
石井鐵工所	2,100	2,461.00	5,168,100
西島製作所	15,600	1,297.00	20,233,200
北越工業	18,200	1,152.00	20,966,400
ダイキン工業	214,600	21,695.00	4,655,747,000
オルガノ	24,800	2,705.00	67,084,000
トーヨーカネツ	6,900	2,437.00	16,815,300
栗田工業	100,600	5,860.00	589,516,000
椿本チエイン	25,500	3,125.00	79,687,500
大同工業	7,400	753.00	5,572,200
木村化工機	14,000	680.00	9,520,000
アネスト岩田	30,700	899.00	27,599,300
ダイフク	92,700	7,010.00	649,827,000
サムコ	5,900	3,290.00	19,411,000
加藤製作所	8,700	745.00	6,481,500
油研工業	2,800	1,778.00	4,978,400
タダノ	95,000	912.00	86,640,000
フジテック	65,800	2,871.00	188,911,800
C K D	49,800	1,850.00	92,130,000
平和	59,800	2,414.00	144,357,200

理想科学工業	16,200	2,264.00	36,676,800
SANKYO	35,300	4,970.00	175,441,000
日本金銭機械	19,900	776.00	15,442,400
マースグループホールディングス	11,200	1,944.00	21,772,800
フクシマガリレイ	13,200	4,010.00	52,932,000
オーイズミ	7,000	401.00	2,807,000
ダイコク電機	9,900	1,541.00	15,255,900
竹内製作所	32,600	3,020.00	98,452,000
アマノ	51,100	2,534.00	129,487,400
JUKI	28,000	674.00	18,872,000
ジャノメ	18,300	642.00	11,748,600
マックス	22,200	2,028.00	45,021,600
グローリー	46,600	2,040.00	95,064,000
新晃工業	18,200	1,534.00	27,918,800
大和冷機工業	27,600	1,269.00	35,024,400
セガサミーホールディングス	144,600	1,836.00	265,485,600
日本ピストンリング	6,100	1,197.00	7,301,700
リケン	7,100	2,242.00	15,918,200
T P R	21,100	1,245.00	26,269,500
ツバキ・ナカシマ	44,400	1,162.00	51,592,800
ホシザキ	115,700	4,505.00	521,228,500
大豊工業	15,700	703.00	11,037,100
日本精工	330,400	767.00	253,416,800
NTN	354,400	294.00	104,193,600
ジェイテクト	160,000	1,006.00	160,960,000
不二越	13,300	3,980.00	52,934,000
日本トムソン	44,200	536.00	23,691,200
THK	103,800	2,564.00	266,143,200
ユーシン精機	14,500	668.00	9,686,000
前澤給装工業	12,700	902.00	11,455,400
イーグル工業	20,000	1,110.00	22,200,000
前澤工業	11,700	609.00	7,125,300
日本ピラー工業	16,700	2,668.00	44,555,600
キッツ	66,300	824.00	54,631,200
マキタ	223,700	2,715.00	607,345,500
三井E & Sホールディングス	81,300	481.00	39,105,300
日立造船	147,500	890.00	131,275,000
三菱重工業	314,400	5,414.00	1,702,161,600
I H I	113,300	3,555.00	402,781,500
スター精密	34,000	1,713.00	58,242,000
日清紡ホールディングス	146,300	1,020.00	149,226,000
イビデン	103,200	5,290.00	545,928,000



コニカミノルタ	402,500	530.00	213,325,000
ブラザー工業	240,400	2,279.00	547,871,600
ミネベアミツミ	312,900	2,127.00	665,538,300
日立製作所	902,600	7,083.00	6,393,115,800
東芝	346,000	4,961.00	1,716,506,000
三菱電機	1,857,900	1,323.00	2,458,001,700
富士電機	109,300	5,840.00	638,312,000
東洋電機製造	6,400	836.00	5,350,400
安川電機	213,000	4,235.00	902,055,000
シンフォニアテクノロジー	19,800	1,404.00	27,799,200
明電舎	27,300	2,014.00	54,982,200
オリジン	4,000	1,400.00	5,600,000
山洋電気	7,900	6,000.00	47,400,000
デンヨー	13,900	1,361.00	18,917,900
P H C ホールディングス	25,300	1,641.00	41,517,300
東芝テック	26,900	4,000.00	107,600,000
芝浦メカトロニクス	3,500	10,300.00	36,050,000
マブチモーター	44,800	4,100.00	183,680,000
日本電産	436,600	8,099.00	3,536,023,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	14,100	497.00	7,007,700
トレックス・セミコンダクター	8,600	3,025.00	26,015,000
東光高岳	11,100	1,782.00	19,780,200
ダブル・スコープ	58,700	1,769.00	103,840,300
ダイヘン	16,200	3,905.00	63,261,000
ヤーマン	35,400	1,088.00	38,515,200
J V C ケンウッド	165,900	313.00	51,926,700
ミマキエンジニアリング	17,700	670.00	11,859,000
I - P E X	10,300	1,345.00	13,853,500
日新電機	43,100	1,360.00	58,616,000
大崎電気工業	42,600	510.00	21,726,000
オムロン	164,700	6,737.00	1,109,583,900
日東工業	24,200	2,232.00	54,014,400
I D E C	26,500	3,095.00	82,017,500
正興電機製作所	7,300	994.00	7,256,200
不二電機工業	4,000	1,094.00	4,376,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	59,200	2,160.00	127,872,000
サクサホールディングス	3,700	1,291.00	4,776,700
メルコホールディングス	5,400	3,035.00	16,389,000
テクノメディカ	4,700	1,623.00	7,628,100
日本電気	254,300	4,660.00	1,185,038,000
富士通	179,100	17,205.00	3,081,415,500
沖電気工業	81,300	738.00	59,999,400

岩崎通信機	7,800	793.00	6,185,400
電気興業	8,700	2,368.00	20,601,600
サンケン電気	16,700	6,050.00	101,035,000
ナカヨ	2,900	1,094.00	3,172,600
アイホン	10,900	1,820.00	19,838,000
ルネサスエレクトロニクス	1,172,900	1,304.00	1,529,461,600
セイコーエプソン	239,400	2,017.00	482,869,800
ワコム	143,100	614.00	87,863,400
アルバック	42,700	5,900.00	251,930,000
アクセル	7,100	1,356.00	9,627,600
E I Z O	13,200	3,735.00	49,302,000
日本信号	40,900	996.00	40,736,400
京三製作所	37,600	399.00	15,002,400
能美防災	24,600	1,545.00	38,007,000
ホーチキ	13,700	1,336.00	18,303,200
星和電機	8,200	432.00	3,542,400
エレコム	43,300	1,455.00	63,001,500
パナソニック ホールディングス	2,123,500	1,199.50	2,547,138,250
シャープ	216,500	896.00	193,984,000
アンリツ	126,600	1,465.00	185,469,000
富士通ゼネラル	50,900	3,225.00	164,152,500
ソニーグループ	1,259,100	11,020.00	13,875,282,000
T D K	284,700	4,830.00	1,375,101,000
帝国通信工業	8,900	1,408.00	12,531,200
タムラ製作所	77,100	712.00	54,895,200
アルプスアルパイン	161,000	1,250.00	201,250,000
池上通信機	5,700	538.00	3,066,600
日本電波工業	21,800	1,665.00	36,297,000
鈴木	11,100	880.00	9,768,000
メイコー	19,800	2,823.00	55,895,400
日本トリム	4,200	2,433.00	10,218,600
ローランド ディー・ジー・	10,300	3,200.00	32,960,000
フォスター電機	16,600	819.00	13,595,400
S M K	4,300	2,679.00	11,519,700
ヨコオ	14,500	2,304.00	33,408,000
ホシデン	43,400	1,549.00	67,226,600
ヒロセ電機	29,700	17,990.00	534,303,000
日本航空電子工業	36,900	2,293.00	84,611,700
T O A	20,900	752.00	15,716,800
マクセル	39,400	1,348.00	53,111,200
古野電気	23,800	1,004.00	23,895,200
スミダコーポレーション	16,900	1,273.00	21,513,700

アイコム	6,900	2,534.00	17,484,600
リオン	7,600	1,952.00	14,835,200
横河電機	196,700	2,535.00	498,634,500
新電元工業	6,900	3,290.00	22,701,000
アズビル	124,300	3,960.00	492,228,000
東亜ディーケーケー	8,900	850.00	7,565,000
日本光電工業	82,400	3,355.00	276,452,000
チノー	7,400	1,799.00	13,312,600
共和電業	16,800	337.00	5,661,600
日本電子材料	11,800	1,485.00	17,523,000
堀場製作所	39,600	6,110.00	241,956,000
アドバンテスト	140,200	8,170.00	1,145,434,000
小野測器	7,800	372.00	2,901,600
エスペック	14,500	1,915.00	27,767,500
キーエンス	178,100	57,110.00	10,171,291,000
日置電機	9,400	6,700.00	62,980,000
シスメックス	153,600	7,976.00	1,225,113,600
日本マイクロニクス	29,600	1,478.00	43,748,800
メガチップス	14,800	2,525.00	37,370,000
O B A R A G R O U P	8,500	3,405.00	28,942,500
澤藤電機	2,500	1,151.00	2,877,500
原田工業	8,400	777.00	6,526,800
コーセル	24,300	851.00	20,679,300
イリソ電子工業	16,500	4,905.00	80,932,500
オブテックスグループ	32,900	1,956.00	64,352,400
千代田インテグレ	7,400	2,304.00	17,049,600
レーザーテック	87,900	23,450.00	2,061,255,000
スタンレー電気	126,900	2,671.00	338,949,900
岩崎電気	6,300	2,386.00	15,031,800
ウシオ電機	93,300	1,668.00	155,624,400
岡谷電機産業	15,500	274.00	4,247,000
ヘリオス テクノ ホールディング	17,300	485.00	8,390,500
エノモト	4,800	1,716.00	8,236,800
日本セラミック	18,300	2,580.00	47,214,000
遠藤照明	8,600	738.00	6,346,800
古河電池	13,500	1,015.00	13,702,500
双信電機	8,300	408.00	3,386,400
山一電機	15,800	1,921.00	30,351,800
図研	15,600	2,990.00	46,644,000
日本電子	44,700	5,320.00	237,804,000
カシオ計算機	132,600	1,288.00	170,788,800
ファナック	174,700	19,790.00	3,457,313,000

日本シイエムケイ	38,700	587.00	22,716,900
エンプラス	5,300	4,295.00	22,763,500
大真空	22,200	960.00	21,312,000
ローム	82,300	10,780.00	887,194,000
浜松ホトニクス	142,900	6,720.00	960,288,000
三井ハイテック	18,400	7,740.00	142,416,000
新光電気工業	63,100	3,955.00	249,560,500
京セラ	276,500	6,760.00	1,869,140,000
太陽誘電	86,800	4,210.00	365,428,000
村田製作所	539,900	7,327.00	3,955,847,300
双葉電子工業	34,700	594.00	20,611,800
北陸電気工業	7,100	1,068.00	7,582,800
ニチコン	36,700	1,416.00	51,967,200
日本ケミコン	17,800	1,850.00	32,930,000
K O A	27,200	2,177.00	59,214,400
市光工業	26,800	408.00	10,934,400
小糸製作所	214,300	2,153.00	461,387,900
ミツバ	33,400	472.00	15,764,800
S C R E E Nホールディングス	30,400	8,290.00	252,016,000
キャノン電子	20,000	1,574.00	31,480,000
キャノン	976,500	3,198.00	3,122,847,000
リコー	466,700	1,037.00	483,967,900
象印マホービン	53,500	1,546.00	82,711,000
M U T O Hホールディングス	2,700	1,833.00	4,949,100
東京エレクトロン	125,600	40,920.00	5,139,552,000
イノテック	12,200	1,259.00	15,359,800
トヨタ紡織	74,900	1,912.00	143,208,800
芦森工業	3,300	1,057.00	3,488,100
ユニプレス	31,900	877.00	27,976,300
豊田自動織機	130,100	7,550.00	982,255,000
モリタホールディングス	31,600	1,219.00	38,520,400
三櫻工業	27,200	676.00	18,387,200
デンソー	367,100	7,247.00	2,660,373,700
東海理化電機製作所	50,200	1,574.00	79,014,800
川崎重工業	134,100	2,857.00	383,123,700
名村造船所	45,500	580.00	26,390,000
日本車輛製造	6,800	1,961.00	13,334,800
三菱ロジスネクスト	28,400	844.00	23,969,600
近畿車輛	2,500	958.00	2,395,000
日産自動車	2,528,400	488.40	1,234,870,560
いすゞ自動車	517,500	1,758.00	909,765,000
トヨタ自動車	9,773,400	1,958.50	19,141,203,900

日野自動車	229,500	616.00	141,372,000
三菱自動車工業	694,400	630.00	437,472,000
エフテック	12,300	514.00	6,322,200
レシップホールディングス	7,000	472.00	3,304,000
G M B	3,500	737.00	2,579,500
ファルテック	2,800	612.00	1,713,600
武蔵精密工業	43,500	1,717.00	74,689,500
日産車体	31,400	840.00	26,376,000
新明和工業	55,900	1,041.00	58,191,900
極東開発工業	31,300	1,372.00	42,943,600
トピー工業	14,400	1,694.00	24,393,600
ティラド	4,800	2,437.00	11,697,600
曙ブレーキ工業	108,600	177.00	19,222,200
タチエス	28,100	1,080.00	30,348,000
N O K	69,100	1,215.00	83,956,500
フタバ産業	47,700	372.00	17,744,400
K Y B	17,100	3,455.00	59,080,500
大同メタル工業	36,200	484.00	17,520,800
プレス工業	83,800	418.00	35,028,400
ミクニ	20,300	305.00	6,191,500
太平洋工業	40,800	1,049.00	42,799,200
河西工業	23,600	189.00	4,460,400
アイシン	137,300	3,770.00	517,621,000
マツダ	588,700	1,014.00	596,941,800
今仙電機製作所	11,200	541.00	6,059,200
本田技研工業	1,446,800	3,289.00	4,758,525,200
スズキ	326,900	5,140.00	1,680,266,000
S U B A R U	563,200	2,432.50	1,369,984,000
安永	7,700	723.00	5,567,100
ヤマハ発動機	279,700	3,515.00	983,145,500
T B K	17,600	282.00	4,963,200
エクセディ	29,100	1,664.00	48,422,400
豊田合成	51,900	2,329.00	120,875,100
愛三工業	29,400	704.00	20,697,600
盟和産業	2,500	926.00	2,315,000
日本プラスト	13,900	432.00	6,004,800
ヨロズ	16,700	800.00	13,360,000
エフ・シー・シー	31,500	1,418.00	44,667,000
シマノ	72,800	23,080.00	1,680,224,000
テイ・エス テック	81,500	1,539.00	125,428,500
ジャムコ	9,600	1,614.00	15,494,400
テルモ	556,100	4,283.00	2,381,776,300

クリエートメディック	5,800	867.00	5,028,600
日機装	44,500	1,011.00	44,989,500
日本エム・ディ・エム	10,600	1,106.00	11,723,600
島津製作所	216,800	4,080.00	884,544,000
JMS	16,500	515.00	8,497,500
長野計器	13,000	1,064.00	13,832,000
ブイ・テクノロジー	8,700	2,785.00	24,229,500
東京計器	13,700	1,289.00	17,659,300
愛知時計電機	6,900	1,363.00	9,404,700
インターアクション	10,700	1,376.00	14,723,200
オーバル	15,700	441.00	6,923,700
東京精密	39,000	4,230.00	164,970,000
マニー	78,300	2,109.00	165,134,700
ニコン	276,700	1,481.00	409,792,700
トプコン	93,700	1,579.00	147,952,300
オリンパス	1,112,700	2,975.50	3,310,838,850
理研計器	11,000	4,205.00	46,255,000
タムロン	13,300	3,250.00	43,225,000
HOYA	384,500	13,565.00	5,215,742,500
シード	9,000	500.00	4,500,000
ノーリツ鋼機	16,900	2,660.00	44,954,000
A & Dホロンホールディングス	26,000	1,016.00	26,416,000
朝日インテック	235,100	2,392.00	562,359,200
シチズン時計	195,700	614.00	120,159,800
リズム	5,500	1,664.00	9,152,000
大研医器	13,400	458.00	6,137,200
メニコン	61,100	2,245.00	137,169,500
シンシア	1,700	506.00	860,200
松風	8,100	2,370.00	19,197,000
セイコーグループ	27,600	3,170.00	87,492,000
ニプロ	148,400	1,021.00	151,516,400
KYORITSU	26,400	118.00	3,115,200
中本パックス	5,400	1,504.00	8,121,600
スノーピーク	30,500	1,936.00	59,048,000
パラマウントベッドホールディングス	41,100	2,630.00	108,093,000
トランザクション	13,700	1,171.00	16,042,700
粧美堂	4,800	369.00	1,771,200
ニホンフラッシュ	16,700	961.00	16,048,700
前田工織	19,300	2,814.00	54,310,200
永大産業	18,900	216.00	4,082,400
アートネイチャー	18,300	760.00	13,908,000
バンダイナムコホールディングス	162,500	9,416.00	1,530,100,000

アイフィスジャパン	4,900	609.00	2,984,100
S H O E I	18,800	5,470.00	102,836,000
フランスベッドホールディングス	24,600	909.00	22,361,400
パイロットコーポレーション	27,800	4,910.00	136,498,000
萩原工業	11,900	1,016.00	12,090,400
フジシールインターナショナル	36,000	1,835.00	66,060,000
タカラトミー	82,200	1,245.00	102,339,000
広済堂ホールディングス	11,900	1,744.00	20,753,600
エステールホールディングス	4,100	608.00	2,492,800
タカノ	6,600	646.00	4,263,600
プロネクサス	14,800	943.00	13,956,400
ホクシン	13,600	144.00	1,958,400
ウッドワン	5,900	899.00	5,304,100
大建工業	10,800	2,089.00	22,561,200
凸版印刷	232,800	2,168.00	504,710,400
大日本印刷	211,200	2,918.00	616,281,600
共同印刷	5,100	2,889.00	14,733,900
N I S S H A	33,800	1,734.00	58,609,200
光村印刷	1,500	1,165.00	1,747,500
T A K A R A & C O M P A N Y	12,300	2,139.00	26,309,700
アシックス	164,300	2,429.00	399,084,700
ツツミ	4,700	1,975.00	9,282,500
ローランド	13,100	3,915.00	51,286,500
小松ウオール工業	6,500	1,859.00	12,083,500
ヤマハ	112,200	5,280.00	592,416,000
河合楽器製作所	4,800	2,644.00	12,691,200
クリナップ	19,900	629.00	12,517,100
ピジョン	113,400	1,923.00	218,068,200
兼松サステック	1,200	1,535.00	1,842,000
キングジム	15,700	904.00	14,192,800
リンテック	35,700	2,213.00	79,004,100
イトーキ	36,500	429.00	15,658,500
任天堂	1,123,700	5,756.00	6,468,017,200
三菱鉛筆	25,300	1,405.00	35,546,500
タカラスタANDARD	34,400	1,254.00	43,137,600
コクヨ	85,700	1,861.00	159,487,700
ナカバヤシ	19,200	515.00	9,888,000
グローブライド	14,400	2,479.00	35,697,600
オカムラ	53,600	1,427.00	76,487,200
美津濃	17,700	2,941.00	52,055,700
東京電力ホールディングス	1,604,500	463.00	742,883,500
中部電力	655,900	1,247.00	817,907,300

関西電力	687,300	1,158.00	795,893,400
中国電力	283,500	712.00	201,852,000
北陸電力	168,000	489.00	82,152,000
東北電力	435,100	624.00	271,502,400
四国電力	151,900	731.00	111,038,900
九州電力	410,300	728.00	298,698,400
北海道電力	172,000	444.00	76,368,000
沖縄電力	41,700	1,012.00	42,200,400
電源開発	134,000	2,163.00	289,842,000
エフオン	13,000	627.00	8,151,000
イーレックス	31,600	2,364.00	74,702,400
レノバ	47,300	2,630.00	124,399,000
東京瓦斯	376,300	2,525.00	950,157,500
大阪瓦斯	360,500	2,075.00	748,037,500
東邦瓦斯	70,100	2,595.00	181,909,500
北海道瓦斯	10,600	1,670.00	17,702,000
広島ガス	37,500	341.00	12,787,500
西部ガスホールディングス	17,500	1,618.00	28,315,000
静岡ガス	40,600	997.00	40,478,200
メタウォーター	22,300	1,869.00	41,678,700
SBSホールディングス	15,900	2,933.00	46,634,700
東武鉄道	195,500	3,195.00	624,622,500
相鉄ホールディングス	58,800	2,082.00	122,421,600
東急	499,100	1,633.00	815,030,300
京浜急行電鉄	201,900	1,428.00	288,313,200
小田急電鉄	269,800	1,657.00	447,058,600
京王電鉄	94,100	4,870.00	458,267,000
京成電鉄	114,800	3,700.00	424,760,000
富士急行	21,900	4,845.00	106,105,500
東日本旅客鉄道	301,900	7,813.00	2,358,744,700
西日本旅客鉄道	227,400	5,666.00	1,288,448,400
東海旅客鉄道	137,100	16,440.00	2,253,924,000
西武ホールディングス	215,300	1,290.00	277,737,000
鴻池運輸	30,300	1,592.00	48,237,600
西日本鉄道	47,500	2,696.00	128,060,000
ハマキョウレックス	13,900	3,325.00	46,217,500
サカイ引越センター	8,500	4,620.00	39,270,000
近鉄グループホールディングス	177,700	4,765.00	846,740,500
阪急阪神ホールディングス	237,000	4,135.00	979,995,000
南海電気鉄道	84,900	2,870.00	243,663,000
京阪ホールディングス	73,500	3,610.00	265,335,000
神戸電鉄	4,800	3,195.00	15,336,000



名古屋鉄道	196,400	2,177.00	427,562,800
山陽電気鉄道	13,400	2,188.00	29,319,200
アルプス物流	14,200	1,127.00	16,003,400
ヤマトホールディングス	227,500	2,245.00	510,737,500
山九	45,200	4,875.00	220,350,000
丸運	8,700	213.00	1,853,100
丸全昭和運輸	11,000	3,055.00	33,605,000
センコーグループホールディングス	94,100	997.00	93,817,700
トナミホールディングス	3,900	3,580.00	13,962,000
ニッコンホールディングス	56,900	2,403.00	136,730,700
日本石油輸送	1,800	2,185.00	3,933,000
福山通運	14,800	3,405.00	50,394,000
セイノーホールディングス	110,600	1,160.00	128,296,000
エスライン	5,000	798.00	3,990,000
神奈川中央交通	5,000	3,280.00	16,400,000
日立物流	39,200	8,890.00	348,488,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	42,900	1,484.00	63,663,600
C & F ロジホールディングス	17,100	1,144.00	19,562,400
九州旅客鉄道	125,600	2,896.00	363,737,600
S Gホールディングス	341,000	1,958.00	667,678,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	66,300	7,490.00	496,587,000
日本郵船	476,100	2,692.50	1,281,899,250
商船三井	313,900	3,075.00	965,242,500
川崎汽船	152,200	2,586.00	393,589,200
N Sユナイテッド海運	10,100	3,645.00	36,814,500
飯野海運	67,700	865.00	58,560,500
共栄タンカー	5,100	932.00	4,753,200
乾汽船	23,500	1,885.00	44,297,500
日本航空	436,400	2,740.00	1,195,736,000
A N Aホールディングス	483,500	2,886.50	1,395,622,750
パスコ	3,400	1,292.00	4,392,800
ランコム	5,200	7,550.00	39,260,000
日新	13,500	2,001.00	27,013,500
三菱倉庫	38,200	3,340.00	127,588,000
三井倉庫ホールディングス	16,600	3,545.00	58,847,000
住友倉庫	48,800	2,042.00	99,649,600
澁澤倉庫	7,100	2,059.00	14,618,900
東陽倉庫	23,500	254.00	5,969,000
日本トランスシティ	35,800	486.00	17,398,800
ケイヒン	3,100	1,525.00	4,727,500
中央倉庫	9,000	924.00	8,316,000
川西倉庫	3,000	985.00	2,955,000

安田倉庫	12,400	924.00	11,457,600
ファイブホールディングス	3,200	1,000.00	3,200,000
東洋埠頭	5,100	1,275.00	6,502,500
上組	88,400	2,833.00	250,437,200
サンリツ	3,900	697.00	2,718,300
キムラユニティー	8,400	798.00	6,703,200
キューソー流通システム	10,600	1,053.00	11,161,800
東海運	10,400	270.00	2,808,000
エーアイティー	11,100	1,440.00	15,984,000
内外トランスライン	6,400	2,068.00	13,235,200
日本コンセプト	5,500	1,823.00	10,026,500
NEC ネットエスアイ	59,800	1,629.00	97,414,200
クロスキャット	10,300	1,302.00	13,410,600
システナ	300,700	420.00	126,294,000
デジタルアーツ	11,300	6,100.00	68,930,000
日鉄ソリューションズ	30,500	3,450.00	105,225,000
キューブシステム	10,800	1,000.00	10,800,000
コア	8,300	1,433.00	11,893,900
手間いらず	3,100	5,050.00	15,655,000
ラクーンホールディングス	17,900	1,211.00	21,676,900
ソリトンシステムズ	9,400	1,114.00	10,471,600
ソフトクリエイトホールディングス	8,000	3,340.00	26,720,000
T I S	200,700	4,010.00	804,807,000
J N Sホールディングス	8,600	341.00	2,932,600
グリー	96,000	787.00	75,552,000
G M Oペパボ	2,700	2,125.00	5,737,500
コーエーテクモホールディングス	112,000	2,290.00	256,480,000
三菱総合研究所	8,800	4,795.00	42,196,000
電算	2,200	1,608.00	3,537,600
A G S	7,800	612.00	4,773,600
ファインデックス	14,500	593.00	8,598,500
ブレインパッド	18,100	843.00	15,258,300
K L a b	35,200	491.00	17,283,200
ポールトゥウィンホールディングス	30,700	907.00	27,844,900
ネクソン	461,300	2,473.00	1,140,794,900
アイスタイル	57,600	503.00	28,972,800
エムアップホールディングス	22,000	1,336.00	29,392,000
エイチーム	13,500	753.00	10,165,500
エニグモ	23,100	536.00	12,381,600
テクノスジャパン	15,100	470.00	7,097,000
コロブラ	69,500	688.00	47,816,000
ブロードリーフ	104,700	493.00	51,617,100

クロス・マーケティンググループ	7,400	875.00	6,475,000
デジタルハーツホールディングス	11,200	1,956.00	21,907,200
システム情報	16,000	996.00	15,936,000
メディアドゥ	7,300	1,927.00	14,067,100
じげん	52,700	355.00	18,708,500
ブイキューブ	21,600	800.00	17,280,000
エンカレッジ・テクノロジー	4,600	510.00	2,346,000
サイバーリンクス	5,900	1,314.00	7,752,600
フィックスターズ	20,300	1,119.00	22,715,700
CARTA HOLDINGS	8,700	1,697.00	14,763,900
オブティム	14,900	921.00	13,722,900
セレス	7,400	890.00	6,586,000
SHIFT	13,100	22,890.00	299,859,000
ティーガイア	18,800	1,656.00	31,132,800
セック	2,600	2,185.00	5,681,000
テクマトリックス	32,700	1,608.00	52,581,600
プロシップ	7,900	1,547.00	12,221,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	54,700	2,205.00	120,613,500
GMOペイメントゲートウェイ	40,800	10,750.00	438,600,000
ザッパラス	7,200	351.00	2,527,200
システムリサーチ	5,700	2,034.00	11,593,800
インターネットイニシアティブ	99,700	2,340.00	233,298,000
さくらインターネット	20,500	532.00	10,906,000
ヴィンクス	5,400	1,467.00	7,921,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,500	4,415.00	24,282,500
SRAホールディングス	9,200	3,240.00	29,808,000
システムインテグレータ	5,800	458.00	2,656,400
朝日ネット	19,500	588.00	11,466,000
eBASE	25,500	563.00	14,356,500
アバントグループ	22,700	1,430.00	32,461,000
アドソル日進	7,600	1,425.00	10,830,000
ODKソリューションズ	4,300	602.00	2,588,600
フリービット	11,100	1,077.00	11,954,700
コムチュア	23,700	2,533.00	60,032,100
サイバーコム	3,000	1,401.00	4,203,000
アステリア	14,200	778.00	11,047,600
アイル	10,100	1,833.00	18,513,300
マークライنز	9,800	2,497.00	24,470,600
メディカル・データ・ビジョン	26,800	1,015.00	27,202,000
gumi	29,400	783.00	23,020,200
ショーケース	4,700	354.00	1,663,800
モバイルファクトリー	4,000	967.00	3,868,000

テラスカイ	7,800	2,324.00	18,127,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,400	1,731.00	16,271,400
P C Iホールディングス	7,600	1,063.00	8,078,800
アイビーシー	3,200	461.00	1,475,200
ネオジャパン	6,200	1,011.00	6,268,200
P R T I M E S	4,600	2,401.00	11,044,600
ラクス	84,600	1,641.00	138,828,600
ランドコンピュータ	4,600	834.00	3,836,400
ダブルスタンダード	7,300	2,544.00	18,571,200
オープンドア	12,600	1,753.00	22,087,800
マイネット	6,200	462.00	2,864,400
アカツキ	8,600	2,262.00	19,453,200
ベネフィットジャパン	1,200	1,513.00	1,815,600
U b i c o mホールディングス	5,600	2,127.00	11,911,200
カナミックネットワーク	26,000	652.00	16,952,000
ノムラシステムコーポレーション	18,500	121.00	2,238,500
チェンジ	43,800	1,858.00	81,380,400
シンクロ・フード	10,500	465.00	4,882,500
オークネット	9,400	1,891.00	17,775,400
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	565.00	2,147,000
セグエグループ	5,200	880.00	4,576,000
エイトレッド	2,800	1,440.00	4,032,000
マクロミル	40,600	1,113.00	45,187,800
ビーグリー	3,100	1,386.00	4,296,600
オロ	5,500	1,610.00	8,855,000
ユーザーローカル	6,600	1,580.00	10,428,000
テモナ	4,200	265.00	1,113,000
ニーズウェル	5,800	684.00	3,967,200
マネーフォワード	43,000	4,335.00	186,405,000
サインポスト	6,400	726.00	4,646,400
電算システムホールディングス	8,700	2,318.00	20,166,600
ソルクシーズ	15,000	364.00	5,460,000
フェイス	5,400	534.00	2,883,600
プロトコーポレーション	22,500	1,189.00	26,752,500
ハイマックス	5,700	1,486.00	8,470,200
野村総合研究所	366,300	3,105.00	1,137,361,500
サイバネットシステム	15,200	984.00	14,956,800
C Eホールディングス	9,600	496.00	4,761,600
日本システム技術	7,100	1,456.00	10,337,600
インテージホールディングス	24,400	1,488.00	36,307,200
東邦システムサイエンス	5,200	1,000.00	5,200,000
ソースネクスト	91,500	299.00	27,358,500

インフォコム	23,100	2,021.00	46,685,100
シンプレクス・ホールディングス	29,900	2,180.00	65,182,000
HEROZ	6,200	1,094.00	6,782,800
ラクスル	25,200	2,805.00	70,686,000
メルカリ	80,400	2,714.00	218,205,600
I P S	5,900	3,100.00	18,290,000
F I G	21,200	394.00	8,352,800
システムサポート	7,800	1,452.00	11,325,600
イーソル	11,800	643.00	7,587,400
アルテリア・ネットワークス	16,800	1,218.00	20,462,400
東海ソフト	3,200	901.00	2,883,200
ウイングアーク1st	18,400	2,237.00	41,160,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,900	1,681.00	8,236,900
サーバーワークス	3,700	2,521.00	9,327,700
東名	1,500	1,457.00	2,185,500
ヴィッツ	2,000	933.00	1,866,000
トピラシステムズ	4,700	1,009.00	4,742,300
Sansan	66,700	1,474.00	98,315,800
Link-U	3,700	837.00	3,096,900
ギフトィ	19,300	2,224.00	42,923,200
ベース	6,100	3,950.00	24,095,000
JMDC	29,300	4,885.00	143,130,500
フォーカスシステムズ	13,200	1,015.00	13,398,000
クレスコ	13,900	1,709.00	23,755,100
フジ・メディア・ホールディングス	171,700	1,018.00	174,790,600
オービック	59,700	21,260.00	1,269,222,000
ジャストシステム	25,700	3,075.00	79,027,500
TDCソフト	15,200	1,302.00	19,790,400
Zホールディングス	2,541,000	350.50	890,620,500
トレンドマイクロ	103,100	7,040.00	725,824,000
IDホールディングス	12,300	916.00	11,266,800
日本オラクル	34,200	7,870.00	269,154,000
アルファシステムズ	5,700	4,315.00	24,595,500
フューチャー	44,600	1,576.00	70,289,600
CAC Holdings	11,100	1,487.00	16,505,700
SBテクノロジー	7,700	2,012.00	15,492,400
トーセ	4,900	770.00	3,773,000
オービックビジネスコンサルタント	35,200	4,015.00	141,328,000
伊藤忠テクノソリューションズ	95,900	3,145.00	301,605,500
アイティフォー	23,800	772.00	18,373,600
東計電算	2,500	5,820.00	14,550,000
エクスネット	2,700	997.00	2,691,900

大塚商会	101,200	4,315.00	436,678,000
サイボウズ	24,700	2,042.00	50,437,400
電通国際情報サービス	21,700	4,595.00	99,711,500
A C C E S S	21,400	800.00	17,120,000
デジタルガレージ	31,700	3,595.00	113,961,500
E Mシステムズ	30,000	940.00	28,200,000
ウェザーニューズ	6,300	7,630.00	48,069,000
C I J	16,600	814.00	13,512,400
ビジネスエンジニアリング	3,900	2,015.00	7,858,500
日本エンタープライズ	20,100	140.00	2,814,000
WOWOW	10,300	1,220.00	12,566,000
スカラ	18,000	740.00	13,320,000
インテリジェント ウェイブ	9,700	716.00	6,945,200
WOW WORLD GROUP	3,000	1,015.00	3,045,000
I M A G I C A G R O U P	15,100	766.00	11,566,600
ネットワンシステムズ	66,600	3,240.00	215,784,000
システムソフト	64,400	100.00	6,440,000
アルゴグラフィックス	16,400	3,600.00	59,040,000
マーベラス	29,300	690.00	20,217,000
エイベックス	30,500	1,614.00	49,227,000
B I P R O G Y	65,800	3,105.00	204,309,000
兼松エレクトロニクス	11,500	4,490.00	51,635,000
都築電気	9,600	1,336.00	12,825,600
T B S ホールディングス	91,500	1,511.00	138,256,500
日本テレビホールディングス	158,200	1,050.00	166,110,000
朝日放送グループホールディングス	17,100	625.00	10,687,500
テレビ朝日ホールディングス	43,500	1,326.00	57,681,000
スカパーJ S A Tホールディングス	158,800	509.00	80,829,200
テレビ東京ホールディングス	13,000	1,830.00	23,790,000
日本BS放送	6,600	915.00	6,039,000
ビジョン	23,700	1,267.00	30,027,900
スマートバリュー	4,800	464.00	2,227,200
U S E N - N E X T H O L D I N G S	16,100	2,259.00	36,369,900
ワイヤレスゲート	8,600	279.00	2,399,400
コネクシオ	12,500	1,102.00	13,775,000
クロップス	3,100	1,045.00	3,239,500
日本電信電話	2,287,400	3,931.00	8,991,769,400
K D D I	1,379,500	4,264.00	5,882,188,000
ソフトバンク	2,867,900	1,479.50	4,243,058,050
光通信	21,000	18,060.00	379,260,000
エムティーアイ	16,700	504.00	8,416,800
G M O インターネットグループ	66,400	2,511.00	166,730,400

ファイバークーゲート	9,800	941.00	9,221,800
アイドママーケティングコミュニケーション	4,900	279.00	1,367,100
KADOKAWA	94,500	2,470.00	233,415,000
学研ホールディングス	29,900	972.00	29,062,800
ゼンリン	30,800	853.00	26,272,400
昭文社ホールディングス	8,400	295.00	2,478,000
インプレスホールディングス	16,700	213.00	3,557,100
アイネット	11,000	1,302.00	14,322,000
松竹	10,200	11,620.00	118,524,000
東宝	111,800	5,030.00	562,354,000
東映	4,900	17,340.00	84,966,000
エヌ・ティ・ティ・データ	560,200	1,890.00	1,058,778,000
ピー・シー・エー	11,000	1,142.00	12,562,000
ビジネスブレイン太田昭和	7,800	1,748.00	13,634,400
D T S	39,300	3,500.00	137,550,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	89,700	6,670.00	598,299,000
シーイーシー	25,200	1,495.00	37,674,000
カプコン	177,400	4,345.00	770,803,000
アイ・エス・ビー	9,300	1,337.00	12,434,100
ジャステック	11,100	1,264.00	14,030,400
S C S K	145,800	2,093.00	305,159,400
N S W	7,000	2,129.00	14,903,000
アイネス	12,700	1,426.00	18,110,200
T K C	32,100	3,700.00	118,770,000
富士ソフト	20,200	8,120.00	164,024,000
N S D	63,800	2,583.00	164,795,400
コナミグループ	76,400	6,370.00	486,668,000
福井コンピュータホールディングス	12,500	3,295.00	41,187,500
J B C Cホールディングス	13,100	1,811.00	23,724,100
ミロク情報サービス	16,400	1,366.00	22,402,400
ソフトバンクグループ	1,032,200	6,833.00	7,053,022,600
高千穂交易	6,700	2,183.00	14,626,100
オルバヘルスケアホールディングス	3,100	1,430.00	4,433,000
伊藤忠食品	4,200	5,110.00	21,462,000
エレマテック	16,900	1,528.00	25,823,200
あらた	14,400	3,750.00	54,000,000
トーメンデバイス	2,700	5,390.00	14,553,000
東京エレクトロン デバイス	6,900	6,790.00	46,851,000
円谷フィールズホールディングス	16,200	2,088.00	33,825,600
双日	199,900	2,462.00	492,153,800
アルフレッサ ホールディングス	189,000	1,633.00	308,637,000
横浜冷凍	51,300	927.00	47,555,100

ラサ商事	8,600	1,033.00	8,883,800
アルコニックス	24,800	1,305.00	32,364,000
神戸物産	145,700	3,295.00	480,081,500
ハイパー	3,600	462.00	1,663,200
あい ホールディングス	30,200	2,243.00	67,738,600
ディーブイエックス	5,200	956.00	4,971,200
ダイワボウホールディングス	77,000	2,093.00	161,161,000
マクニカホールディングス	46,200	3,440.00	158,928,000
ラクト・ジャパン	7,300	2,053.00	14,986,900
グリムス	7,800	1,711.00	13,345,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,200	756.00	22,831,200
八洲電機	15,300	1,020.00	15,606,000
メディアスホールディングス	12,100	695.00	8,409,500
レスターホールディングス	18,000	2,159.00	38,862,000
ジューテックホールディングス	3,900	1,109.00	4,325,100
大光	8,100	687.00	5,564,700
O C H Iホールディングス	4,300	1,231.00	5,293,300
T O K A Iホールディングス	93,000	882.00	82,026,000
黒谷	5,200	565.00	2,938,000
C o m i n i x	3,500	726.00	2,541,000
三洋貿易	19,300	1,144.00	22,079,200
ビューティガレージ	3,400	2,710.00	9,214,000
ウイン・パートナーズ	14,000	966.00	13,524,000
ミタチ産業	4,800	974.00	4,675,200
シップヘルスケアホールディングス	67,700	2,818.00	190,778,600
明治電機工業	7,000	1,022.00	7,154,000
デリカフーズホールディングス	7,400	508.00	3,759,200
スターティアホールディングス	3,700	1,141.00	4,221,700
コメダホールディングス	46,100	2,434.00	112,207,400
ピーバンドットコム	2,700	519.00	1,401,300
アセンテック	6,400	501.00	3,206,400
富士興産	4,200	1,182.00	4,964,400
協栄産業	1,700	1,818.00	3,090,600
フルサト・マルカホールディングス	18,700	3,465.00	64,795,500
ヤマエグループホールディングス	10,700	1,472.00	15,750,400
小野建	17,300	1,466.00	25,361,800
南陽	3,600	1,808.00	6,508,800
佐島電機	11,800	1,305.00	15,399,000
エコトレーディング	3,700	552.00	2,042,400
伯東	10,800	3,465.00	37,422,000
コンドーテック	14,500	987.00	14,311,500
中山福	10,100	317.00	3,201,700



ナガイレーベン	23,800	2,031.00	48,337,800
三菱食品	17,400	3,150.00	54,810,000
松田産業	14,300	2,330.00	33,319,000
第一興商	36,400	4,060.00	147,784,000
メディカルホールディングス	195,300	1,786.00	348,805,800
S P K	8,400	1,403.00	11,785,200
萩原電気ホールディングス	7,200	2,427.00	17,474,400
アズワン	27,500	5,820.00	160,050,000
スズデン	6,600	2,371.00	15,648,600
尾家産業	4,500	833.00	3,748,500
シモジマ	13,000	985.00	12,805,000
ドウシシャ	19,900	1,550.00	30,845,000
小津産業	4,200	1,477.00	6,203,400
高速	10,200	1,690.00	17,238,000
たけびし	7,200	1,554.00	11,188,800
リックス	3,900	2,058.00	8,026,200
丸文	16,800	870.00	14,616,000
ハピネット	16,000	2,010.00	32,160,000
橋本総業ホールディングス	7,500	983.00	7,372,500
日本ライフライン	55,200	961.00	53,047,200
タカショー	16,400	683.00	11,201,200
I D O M	57,000	722.00	41,154,000
進和	12,500	1,944.00	24,300,000
エスケイジャパン	4,600	490.00	2,254,000
ダイترون	7,400	2,321.00	17,175,400
シークス	26,900	1,161.00	31,230,900
田中商事	5,400	543.00	2,932,200
オーハシテクニカ	9,600	1,415.00	13,584,000
白銅	6,800	2,513.00	17,088,400
ダイコー通産	2,300	1,048.00	2,410,400
伊藤忠商事	1,160,400	4,214.00	4,889,925,600
丸紅	1,486,700	1,461.00	2,172,068,700
高島	2,800	2,646.00	7,408,800
長瀬産業	88,500	1,962.00	173,637,000
蝶理	10,300	1,955.00	20,136,500
豊田通商	165,000	5,070.00	836,550,000
三共生興	27,100	471.00	12,764,100
兼松	73,100	1,510.00	110,381,000
ツカモトコーポレーション	2,700	1,181.00	3,188,700
三井物産	1,377,900	3,785.00	5,215,351,500
日本紙パルプ商事	10,000	5,000.00	50,000,000
カメイ	20,600	1,165.00	23,999,000

東都水産	1,000	4,845.00	4,845,000
OUGホールディングス	2,800	2,473.00	6,924,400
スターゼン	14,300	2,046.00	29,257,800
山善	50,800	974.00	49,479,200
椿本興業	3,200	3,770.00	12,064,000
住友商事	1,166,300	2,202.50	2,568,775,750
内田洋行	8,300	4,600.00	38,180,000
三菱商事	1,177,400	4,370.00	5,145,238,000
第一実業	7,300	4,165.00	30,404,500
キャノンマーケティングジャパン	43,600	3,085.00	134,506,000
西華産業	7,900	1,540.00	12,166,000
佐藤商事	13,200	1,154.00	15,232,800
菱洋エレクトロ	16,100	2,300.00	37,030,000
東京産業	17,200	769.00	13,226,800
ユアサ商事	17,000	3,845.00	65,365,000
神鋼商事	4,700	4,240.00	19,928,000
トルク	10,200	215.00	2,193,000
阪和興業	33,800	3,735.00	126,243,000
正栄食品工業	12,500	4,145.00	51,812,500
カナデン	15,300	1,084.00	16,585,200
菱電商事	15,200	1,728.00	26,265,600
岩谷産業	42,900	5,610.00	240,669,000
ナイス	5,100	1,391.00	7,094,100
ニチモウ	2,100	2,497.00	5,243,700
極東貿易	11,300	1,326.00	14,983,800
アステナホールディングス	32,700	417.00	13,635,900
三愛オブリ	52,000	1,185.00	61,620,000
稲畑産業	38,400	2,413.00	92,659,200
G S Iクレオス	11,000	1,429.00	15,719,000
明和産業	25,100	731.00	18,348,100
クワザワホールディングス	6,100	402.00	2,452,200
ワキタ	34,700	1,182.00	41,015,400
東邦ホールディングス	46,900	1,994.00	93,518,600
サンゲツ	47,300	1,992.00	94,221,600
ミツウロコグループホールディングス	24,300	993.00	24,129,900
シナネンホールディングス	6,200	3,775.00	23,405,000
伊藤忠エネクス	46,700	1,017.00	47,493,900
サンリオ	53,400	4,315.00	230,421,000
サンワテクノス	9,600	1,491.00	14,313,600
リョーサン	20,000	2,872.00	57,440,000
新光商事	25,300	1,061.00	26,843,300
トーホー	8,100	1,669.00	13,518,900

三信電気	7,600	2,136.00	16,233,600
東陽テクニカ	20,900	1,325.00	27,692,500
モスフードサービス	27,700	3,100.00	85,870,000
加賀電子	15,300	4,315.00	66,019,500
ソーダニッカ	13,800	619.00	8,542,200
立花エレテック	13,800	1,712.00	23,625,600
フォーバル	7,400	936.00	6,926,400
PALTAC	29,600	4,160.00	123,136,000
三谷産業	33,000	298.00	9,834,000
西本Wismettacホールディングス	4,800	4,105.00	19,704,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	1,531.00	2,602,700
コア商事ホールディングス	13,200	604.00	7,972,800
KPPグループホールディングス	43,900	867.00	38,061,300
ヤマタネ	8,400	1,663.00	13,969,200
丸紅建材リース	1,700	1,724.00	2,930,800
日鉄物産	12,900	5,200.00	67,080,000
泉州電業	9,400	2,621.00	24,637,400
トラスコ中山	39,600	1,969.00	77,972,400
オートバックスセブン	65,600	1,428.00	93,676,800
モリト	13,500	748.00	10,098,000
加藤産業	22,900	3,530.00	80,837,000
北恵	4,200	752.00	3,158,400
イエローハット	33,300	1,705.00	56,776,500
JKホールディングス	14,900	1,034.00	15,406,600
日伝	12,600	1,665.00	20,979,000
北沢産業	10,200	188.00	1,917,600
杉本商事	9,100	1,956.00	17,799,600
因幡電機産業	48,800	2,703.00	131,906,400
東テク	6,300	3,450.00	21,735,000
ミスミグループ本社	284,100	3,030.00	860,823,000
アルテック	10,500	300.00	3,150,000
タキヒヨー	4,600	760.00	3,496,000
蔵王産業	3,100	1,717.00	5,322,700
スズケン	68,800	3,280.00	225,664,000
ジェコス	13,000	799.00	10,387,000
グローセル	20,600	418.00	8,610,800
ローソン	46,800	4,815.00	225,342,000
サンエー	14,400	4,265.00	61,416,000
カワチ薬品	14,900	2,096.00	31,230,400
エービーシー・マート	27,500	6,920.00	190,300,000
ハードオフコーポレーション	7,800	1,329.00	10,366,200
アスクル	45,700	1,576.00	72,023,200

ゲオホールディングス	19,900	1,975.00	39,302,500
アダストリア	22,900	1,986.00	45,479,400
くら寿司	22,100	3,370.00	74,477,000
キャンドウ	6,900	2,129.00	14,690,100
アイケイ	6,800	411.00	2,794,800
パルグループホールディングス	18,600	2,223.00	41,347,800
エディオン	74,800	1,221.00	91,330,800
サーラコーポレーション	40,000	753.00	30,120,000
ワッツ	9,600	656.00	6,297,600
ハローズ	8,800	2,938.00	25,854,400
フジオフードグループ本社	15,700	1,394.00	21,885,800
あみやき亭	4,700	2,891.00	13,587,700
大黒天物産	6,800	4,775.00	32,470,000
ハニーズホールディングス	17,000	1,210.00	20,570,000
ファーマライズホールディングス	4,600	639.00	2,939,400
アルペン	15,700	1,993.00	31,290,100
ハブ	6,700	608.00	4,073,600
クオールホールディングス	26,200	1,146.00	30,025,200
ジーンズホールディングス	11,200	3,880.00	43,456,000
ビックカメラ	125,500	1,151.00	144,450,500
D C Mホールディングス	115,200	1,172.00	135,014,400
Monotaro	267,100	2,203.00	588,421,300
東京一番フーズ	4,900	577.00	2,827,300
きちりホールディングス	5,000	301.00	1,505,000
アーランドサービスホールディングス	15,600	2,177.00	33,961,200
J.フロント リテイリング	234,400	1,162.00	272,372,800
ドトール・日レスホールディングス	33,600	1,649.00	55,406,400
マツキヨココカラ&カンパニー	114,300	5,180.00	592,074,000
ブロンコビリー	10,200	2,467.00	25,163,400
Z O Z O	124,600	3,110.00	387,506,000
トレジャー・ファクトリー	5,700	2,182.00	12,437,400
物語コーポレーション	10,500	6,650.00	69,825,000
三越伊勢丹ホールディングス	317,200	1,262.00	400,306,400
Hamee	8,000	831.00	6,648,000
マーケットエンタープライズ	2,200	1,140.00	2,508,000
ウエルシアホールディングス	97,800	3,035.00	296,823,000
クリエイティブSDホールディングス	31,200	3,135.00	97,812,000
丸善CHIホールディングス	23,200	320.00	7,424,000
ミサワ	4,000	587.00	2,348,000
ティーライフ	2,800	1,283.00	3,592,400
チムニー	5,800	1,081.00	6,269,800
シュッピン	14,200	1,365.00	19,383,000

オイシックス・ラ・大地	25,500	1,680.00	42,840,000
ネクステージ	43,100	2,774.00	119,559,400
ジョイフル本田	60,800	1,819.00	110,595,200
鳥貴族ホールディングス	7,100	2,155.00	15,300,500
ホットランド	14,600	1,393.00	20,337,800
すかいらーくホールディングス	257,600	1,554.00	400,310,400
SFPホールディングス	10,300	1,627.00	16,758,100
綿半ホールディングス	14,800	1,348.00	19,950,400
ヨシックスホールディングス	3,900	2,098.00	8,182,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	61,700	1,070.00	66,019,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,700	1,332.00	11,588,400
B E E N O S	10,800	3,010.00	32,508,000
あさひ	16,000	1,287.00	20,592,000
日本調剤	13,100	1,192.00	15,615,200
コスモス薬品	21,300	14,270.00	303,951,000
トーエル	8,700	706.00	6,142,200
セブン&アイ・ホールディングス	649,100	5,655.00	3,670,660,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	141,700	917.00	129,938,900
ツルハホールディングス	46,100	8,680.00	400,148,000
サンマルクホールディングス	15,400	1,595.00	24,563,000
フェリシモ	4,500	988.00	4,446,000
トリドールホールディングス	46,900	2,818.00	132,164,200
T O K Y O B A S E	20,300	335.00	6,800,500
ウイルプラスホールディングス	3,900	979.00	3,818,100
J Mホールディングス	16,200	1,687.00	27,329,400
サツドラホールディングス	9,000	673.00	6,057,000
アレンザホールディングス	14,400	960.00	13,824,000
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,818.00	9,453,600
パロックジャパンリミテッド	13,200	778.00	10,269,600
クスリのアオキホールディングス	18,900	7,300.00	137,970,000
力の源ホールディングス	10,300	755.00	7,776,500
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	108,300	2,614.00	283,096,200
メディカルシステムネットワーク	17,500	408.00	7,140,000
はるやまホールディングス	8,700	431.00	3,749,700
ノジマ	61,700	1,310.00	80,827,000
カップ・クリエイト	29,600	1,368.00	40,492,800
ライトオン	14,200	610.00	8,662,000
良品計画	243,200	1,378.00	335,129,600
パリティホールディングス	24,800	260.00	6,448,000
アドヴァングループ	18,300	873.00	15,975,900

アルビス	6,300	2,287.00	14,408,100	
コナカ	20,500	329.00	6,744,500	
ハウス オブ ローゼ	2,500	1,600.00	4,000,000	
G - 7ホールディングス	23,700	1,469.00	34,815,300	
イオン北海道	28,000	1,153.00	32,284,000	
コジマ	36,800	610.00	22,448,000	
ヒマラヤ	6,300	908.00	5,720,400	
コーナン商事	25,500	3,220.00	82,110,000	
エコス	7,200	1,830.00	13,176,000	
ワタミ	22,700	955.00	21,678,500	
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	422,400	2,364.00	998,553,600	
西松屋チェーン	41,900	1,344.00	56,313,600	
ゼンショーホールディングス	103,200	3,320.00	342,624,000	
幸楽苑ホールディングス	12,300	1,064.00	13,087,200	
ハークスレイ	7,300	560.00	4,088,000	
サイゼリヤ	31,400	2,854.00	89,615,600	
V Tホールディングス	72,200	499.00	36,027,800	
魚力	6,000	2,109.00	12,654,000	
フジ・コーポレーション	10,900	1,243.00	13,548,700	
ユナイテッドアローズ	20,300	1,880.00	38,164,000	
ハイデイ日高	28,100	1,830.00	51,423,000	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	12,700	208.00	2,641,600	
コロワイド	86,800	1,729.00	150,077,200	
ピーシーデボコーポレーション	22,200	263.00	5,838,600	
壱番屋	14,900	4,540.00	67,646,000	
P L A N T	4,900	630.00	3,087,000	
スギホールディングス	38,000	5,880.00	223,440,000	
薬王堂ホールディングス	10,600	2,632.00	27,899,200	
スクロール	28,400	702.00	19,936,800	
ヨンドシーホールディングス	16,400	1,702.00	27,912,800	
木曽路	28,700	2,103.00	60,356,100	
S R Sホールディングス	31,400	838.00	26,313,200	
千趣会	35,500	395.00	14,022,500	
リテールパートナーズ	28,200	1,238.00	34,911,600	
ケーヨー	30,600	892.00	27,295,200	
上新電機	18,200	1,872.00	34,070,400	
日本瓦斯	101,100	2,172.00	219,589,200	
ロイヤルホールディングス	36,200	2,331.00	84,382,200	
いなげや	18,900	1,134.00	21,432,600	
チヨダ	18,400	721.00	13,266,400	
ライフコーポレーション	16,600	2,333.00	38,727,800	

リンガーハット	24,300	2,186.00	53,119,800
MrMaxHD	26,900	661.00	17,780,900
AOKIホールディングス	35,500	674.00	23,927,000
オークワ	30,400	911.00	27,694,400
コメリ	29,100	2,621.00	76,271,100
青山商事	40,600	975.00	39,585,000
しまむら	22,100	12,190.00	269,399,000
はせがわ	9,700	354.00	3,433,800
高島屋	142,100	1,768.00	251,232,800
松屋	32,200	961.00	30,944,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	91,900	1,213.00	111,474,700
近鉄百貨店	6,200	2,382.00	14,768,400
丸井グループ	139,000	2,325.00	323,175,000
アクシアル リテイリング	12,900	3,315.00	42,763,500
イオン	638,500	2,707.00	1,728,419,500
イズミ	28,700	2,943.00	84,464,100
平和堂	31,600	1,927.00	60,893,200
フジ	29,000	1,853.00	53,737,000
ヤオコー	21,300	6,530.00	139,089,000
ゼビオホールディングス	25,800	990.00	25,542,000
ケーズホールディングス	150,000	1,105.00	165,750,000
Olympicグループ	7,600	501.00	3,807,600
日産東京販売ホールディングス	25,100	276.00	6,927,600
シルバーライフ	4,500	1,518.00	6,831,000
Genky DrugStores	9,400	3,690.00	34,686,000
ナルミヤ・インターナショナル	3,400	824.00	2,801,600
ブックオフグループホールディングス	11,300	1,275.00	14,407,500
ギフトホールディングス	4,100	3,760.00	15,416,000
アインホールディングス	26,000	6,280.00	163,280,000
元気寿司	6,000	3,155.00	18,930,000
ヤマダホールディングス	772,900	463.00	357,852,700
アーケランズ	27,800	1,489.00	41,394,200
ニトリホールディングス	76,200	14,315.00	1,090,803,000
グルメ杵屋	15,700	996.00	15,637,200
愛眼	13,900	174.00	2,418,600
ケーユーホールディングス	11,300	1,188.00	13,424,400
吉野家ホールディングス	73,800	2,290.00	169,002,000
松屋フーズホールディングス	9,200	3,950.00	36,340,000
サガミホールディングス	30,500	1,215.00	37,057,500
関西フードマーケット	17,200	1,332.00	22,910,400
王将フードサービス	12,500	5,960.00	74,500,000
プレナス	20,800	2,635.00	54,808,000

ミニストップ	13,800	1,410.00	19,458,000
アークス	34,700	2,019.00	70,059,300
パローホールディングス	36,100	1,764.00	63,680,400
ベルク	9,400	5,500.00	51,700,000
大庄	10,500	1,037.00	10,888,500
ファーストリテイリング	28,200	80,610.00	2,273,202,000
サンドラッグ	71,600	3,395.00	243,082,000
サクスパー ホールディングス	18,400	719.00	13,229,600
ヤマザワ	3,700	1,152.00	4,262,400
やまや	4,000	2,441.00	9,764,000
ペルーナ	45,800	687.00	31,464,600
いよぎんホールディングス	208,600	677.00	141,222,200
しずおかフィナンシャルグループ	396,100	930.00	368,373,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	147,600	887.00	130,921,200
島根銀行	6,000	419.00	2,514,000
じもとホールディングス	11,600	410.00	4,756,000
めぶきフィナンシャルグループ	869,900	291.00	253,140,900
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,400	2,156.00	48,294,400
九州フィナンシャルグループ	308,400	385.00	118,734,000
ゆうちょ銀行	499,100	998.00	498,101,800
富山第一銀行	43,700	404.00	17,654,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	966,200	452.00	436,722,400
西日本フィナンシャルホールディングス	111,000	751.00	83,361,000
三十三フィナンシャルグループ	15,700	1,437.00	22,560,900
第四北越フィナンシャルグループ	27,500	2,578.00	70,895,000
ひろぎんホールディングス	228,700	620.00	141,794,000
おきなわフィナンシャルグループ	16,700	2,031.00	33,917,700
十六フィナンシャルグループ	22,700	2,458.00	55,796,600
北國フィナンシャルホールディングス	14,800	4,385.00	64,898,000
プロクレアホールディングス	21,500	2,090.00	44,935,000
あいちフィナンシャルグループ	24,500	1,998.00	48,951,000
新生銀行	51,700	2,224.00	114,980,800
あおぞら銀行	110,200	2,581.00	284,426,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,492,700	710.70	8,167,861,890
りそなホールディングス	2,237,300	574.70	1,285,776,310
三井住友トラスト・ホールディングス	324,700	4,403.00	1,429,654,100
三井住友フィナンシャルグループ	1,281,000	4,352.00	5,574,912,000
千葉銀行	488,500	816.00	398,616,000
群馬銀行	340,200	415.00	141,183,000
武蔵野銀行	23,000	1,692.00	38,916,000
千葉興業銀行	40,900	303.00	12,392,700
筑波銀行	76,900	189.00	14,534,100



七十七銀行	56,100	1,765.00	99,016,500
秋田銀行	11,700	1,568.00	18,345,600
山形銀行	19,500	1,025.00	19,987,500
岩手銀行	12,000	1,797.00	21,564,000
東邦銀行	138,700	203.00	28,156,100
東北銀行	8,500	950.00	8,075,000
ふくおかフィナンシャルグループ	139,900	2,561.00	358,283,900
スルガ銀行	154,500	395.00	61,027,500
八十二銀行	359,600	476.00	171,169,600
山梨中央銀行	18,000	1,007.00	18,126,000
大垣共立銀行	33,400	1,740.00	58,116,000
福井銀行	15,700	1,376.00	21,603,200
清水銀行	7,000	1,411.00	9,877,000
富山銀行	2,700	1,632.00	4,406,400
滋賀銀行	29,200	2,454.00	71,656,800
南都銀行	26,400	2,098.00	55,387,200
百五銀行	164,900	326.00	53,757,400
京都銀行	55,500	5,310.00	294,705,000
紀陽銀行	62,700	1,441.00	90,350,700
ほくほくフィナンシャルグループ	111,400	875.00	97,475,000
山陰合同銀行	109,700	716.00	78,545,200
鳥取銀行	5,600	1,062.00	5,947,200
百十四銀行	16,000	1,682.00	26,912,000
四国銀行	27,800	856.00	23,796,800
阿波銀行	25,900	1,827.00	47,319,300
大分銀行	10,500	1,791.00	18,805,500
宮崎銀行	11,400	2,228.00	25,399,200
佐賀銀行	10,300	1,510.00	15,553,000
琉球銀行	40,200	771.00	30,994,200
セブン銀行	628,000	253.00	158,884,000
みずほフィナンシャルグループ	2,535,200	1,645.00	4,170,404,000
高知銀行	6,000	619.00	3,714,000
山口フィナンシャルグループ	193,600	786.00	152,169,600
長野銀行	5,400	1,137.00	6,139,800
名古屋銀行	11,600	2,983.00	34,602,800
北洋銀行	265,600	234.00	62,150,400
大光銀行	5,200	1,121.00	5,829,200
愛媛銀行	24,100	837.00	20,171,700
トマト銀行	5,800	969.00	5,620,200
京葉銀行	81,400	498.00	40,537,200
栃木銀行	80,300	287.00	23,046,100
北日本銀行	6,100	1,865.00	11,376,500

東和銀行	32,200	523.00	16,840,600
福島銀行	18,400	209.00	3,845,600
大東銀行	6,800	608.00	4,134,400
トモニホールディングス	141,700	318.00	45,060,600
フィデアホールディングス	18,100	1,289.00	23,330,900
池田泉州ホールディングス	224,400	216.00	48,470,400
F P G	71,300	1,053.00	75,078,900
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,500	1,263.00	18,313,500
マーキュリアホールディングス	10,700	604.00	6,462,800
S B Iホールディングス	253,800	2,648.00	672,062,400
ジャフコ グループ	58,600	2,225.00	130,385,000
大和証券グループ本社	1,253,900	586.00	734,785,400
野村ホールディングス	3,228,900	481.50	1,554,715,350
岡三証券グループ	154,600	361.00	55,810,600
丸三証券	58,900	404.00	23,795,600
東洋証券	59,200	244.00	14,444,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	191,500	350.00	67,025,000
光世証券	4,600	357.00	1,642,200
水戸証券	48,100	216.00	10,389,600
いちよし証券	32,700	597.00	19,521,900
松井証券	103,800	788.00	81,794,400
マネックスグループ	196,300	420.00	82,446,000
極東証券	22,200	600.00	13,320,000
岩井コスモホールディングス	20,200	1,247.00	25,189,400
アイザワ証券グループ	25,900	641.00	16,601,900
マネーパートナーズグループ	19,000	274.00	5,206,000
スパークス・グループ	19,700	1,572.00	30,968,400
かんぽ生命保険	212,800	2,146.00	456,668,800
S O M P Oホールディングス	300,900	6,259.00	1,883,333,100
アニコム ホールディングス	59,500	660.00	39,270,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	395,200	4,026.00	1,591,075,200
第一生命ホールディングス	892,400	2,423.50	2,162,731,400
東京海上ホールディングス	1,765,200	2,799.50	4,941,677,400
T & Dホールディングス	470,400	1,507.00	708,892,800
アドバンスクリエイト	10,100	1,005.00	10,150,500
全国保証	46,000	4,970.00	228,620,000
あんしん保証	10,300	256.00	2,636,800
イントラスト	7,600	710.00	5,396,000
日本モーゲージサービス	10,400	831.00	8,642,400
C a s a	7,400	861.00	6,371,400
アルヒ	36,400	1,440.00	52,416,000
プレミアグループ	29,800	1,862.00	55,487,600

ネットプロテクションズホールディングス	59,200	425.00	25,160,000
クレディセゾン	111,500	1,590.00	177,285,000
芙蓉総合リース	16,200	8,690.00	140,778,000
みずほリース	26,300	3,310.00	87,053,000
東京センチュリー	32,900	4,905.00	161,374,500
日本証券金融	71,000	929.00	65,959,000
アイフル	291,800	425.00	124,015,000
リコーリース	16,800	3,605.00	60,564,000
イオンフィナンシャルサービス	101,100	1,435.00	145,078,500
アコム	314,700	321.00	101,018,700
ジャックス	18,800	3,705.00	69,654,000
オリエントコーポレーション	46,300	1,189.00	55,050,700
オリックス	1,172,800	2,066.00	2,423,004,800
三菱HCキャピタル	684,400	645.00	441,438,000
九州リースサービス	9,100	620.00	5,642,000
日本取引所グループ	492,900	1,913.50	943,164,150
イー・ギャランティ	28,500	2,386.00	68,001,000
アサックス	8,900	596.00	5,304,400
NECキャピタルソリューション	8,900	2,091.00	18,609,900
大東建託	64,300	14,790.00	950,997,000
いちご	207,100	320.00	66,272,000
日本駐車場開発	216,000	253.00	54,648,000
スター・マイカ・ホールディングス	9,200	1,391.00	12,797,200
SREホールディングス	9,100	4,120.00	37,492,000
ADワークスグループ	44,000	165.00	7,260,000
ヒューリック	410,600	1,103.00	452,891,800
三栄建築設計	9,600	1,422.00	13,651,200
野村不動産ホールディングス	110,100	3,270.00	360,027,000
三重交通グループホールディングス	42,000	493.00	20,706,000
サムティ	28,600	2,354.00	67,324,400
ディア・ライフ	29,300	607.00	17,785,100
地主	14,300	2,050.00	29,315,000
プレサンスコーポレーション	24,200	1,473.00	35,646,600
ハウスコム	4,500	950.00	4,275,000
JPMC	10,600	1,009.00	10,695,400
サンセイランディック	7,200	852.00	6,134,400
フージャースホールディングス	27,000	757.00	20,439,000
オープンハウスグループ	64,500	5,380.00	347,010,000
東急不動産ホールディングス	529,400	756.00	400,226,400
飯田グループホールディングス	154,400	2,128.00	328,563,200
イーランド	3,800	1,540.00	5,852,000
ムゲンエステート	15,500	468.00	7,254,000

And Doホールディングス	10,400	859.00	8,933,600
シーアールイー	9,300	1,499.00	13,940,700
ケイアイスター不動産	8,800	4,570.00	40,216,000
グッドコムアセット	18,700	680.00	12,716,000
ジェイ・エス・ビー	4,800	4,100.00	19,680,000
ロードスターキャピタル	8,600	1,592.00	13,691,200
テンポイノベーション	7,200	936.00	6,739,200
フェイスネットワーク	3,700	1,346.00	4,980,200
パーク24	137,500	1,949.00	267,987,500
パラカ	7,100	1,830.00	12,993,000
三井不動産	762,500	2,718.50	2,072,856,250
三菱地所	1,112,400	1,893.00	2,105,773,200
平和不動産	28,900	3,880.00	112,132,000
東京建物	168,000	1,941.00	326,088,000
京阪神ビルディング	25,900	1,329.00	34,421,100
住友不動産	317,400	3,485.00	1,106,139,000
テーオーシー	34,100	732.00	24,961,200
東京楽天地	3,500	4,235.00	14,822,500
スターツコーポレーション	25,900	2,791.00	72,286,900
フジ住宅	27,400	625.00	17,125,000
空港施設	24,400	533.00	13,005,200
明和地所	11,900	614.00	7,306,600
ゴールドクレスト	17,700	1,714.00	30,337,800
エスリード	9,200	1,892.00	17,406,400
日神グループホールディングス	35,500	425.00	15,087,500
日本エスコン	39,400	812.00	31,992,800
MIRARTHホールディングス	88,600	386.00	34,199,600
AVANTIA	11,200	774.00	8,668,800
イオンモール	92,000	1,607.00	147,844,000
毎日コムネット	9,000	676.00	6,084,000
ファースト住建	8,700	1,010.00	8,787,000
カチタス	47,700	3,205.00	152,878,500
トーセイ	30,400	1,414.00	42,985,600
穴吹興産	5,100	1,951.00	9,950,100
サンフロンティア不動産	30,800	1,176.00	36,220,800
FJネクストホールディングス	20,200	982.00	19,836,400
インテリックス	4,300	547.00	2,352,100
ランドビジネス	6,400	224.00	1,433,600
サンネクスタグループ	7,600	921.00	6,999,600
グランディハウス	17,100	544.00	9,302,400
日本空港ビルデング	62,300	6,080.00	378,784,000
明豊ファシリティワークス	9,300	704.00	6,547,200

日本工営	13,100	3,395.00	44,474,500
L I F U L L	64,600	220.00	14,212,000
M I X I	41,800	2,324.00	97,143,200
ジェイエイシーリクルートメント	16,700	2,508.00	41,883,600
日本M&Aセンターホールディングス	314,000	1,646.00	516,844,000
メンバーズ	5,500	2,016.00	11,088,000
中広	3,300	365.00	1,204,500
UTグループ	27,000	2,467.00	66,609,000
アイティメディア	8,000	1,728.00	13,824,000
E・Jホールディングス	12,000	1,282.00	15,384,000
夢真ビーネックスグループ	67,000	1,914.00	128,238,000
コシダカホールディングス	55,100	1,096.00	60,389,600
アルトナー	4,800	988.00	4,742,400
パソナグループ	22,400	1,972.00	44,172,800
C D S	4,700	1,889.00	8,878,300
リンクアンドモチベーション	52,700	860.00	45,322,000
エス・エム・エス	69,700	3,350.00	233,495,000
サニーサイドアップグループ	7,000	561.00	3,927,000
パーソルホールディングス	204,900	3,095.00	634,165,500
リニカル	10,800	729.00	7,873,200
クックパッド	51,700	197.00	10,184,900
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,500	622.00	5,909,000
学情	8,500	1,488.00	12,648,000
スタジオアリス	9,300	2,076.00	19,306,800
シミックホールディングス	10,300	1,576.00	16,232,800
エプロ	4,400	661.00	2,908,400
N J S	4,200	2,075.00	8,715,000
総合警備保障	68,000	3,635.00	247,180,000
カカクコム	136,800	2,225.00	304,380,000
アイロムグループ	6,700	2,233.00	14,961,100
セントケア・ホールディング	12,400	799.00	9,907,600
サイネックス	3,700	533.00	1,972,100
ルネサンス	13,200	925.00	12,210,000
ディップ	32,100	4,140.00	132,894,000
デジタルホールディングス	14,600	1,150.00	16,790,000
新日本科学	19,500	2,602.00	50,739,000
キャリアデザインセンター	4,000	1,561.00	6,244,000
ベネフィット・ワン	84,900	1,997.00	169,545,300
エムスリー	361,600	4,108.00	1,485,452,800
ツカダ・グローバルホールディング	11,700	404.00	4,726,800
アウトソーシング	109,300	1,184.00	129,411,200
ウェルネット	16,700	581.00	9,702,700

ワールドホールディングス	8,300	2,636.00	21,878,800
ディー・エヌ・エー	78,200	1,860.00	145,452,000
博報堂D Yホールディングス	233,600	1,245.00	290,832,000
ぐるなび	34,400	388.00	13,347,200
タカミヤ	25,700	381.00	9,791,700
ジャパンベストレスキューシステム	11,400	791.00	9,017,400
ファンコミュニケーションズ	36,600	430.00	15,738,000
ライク	7,000	2,122.00	14,854,000
ビジネス・ブレークスルー	7,700	389.00	2,995,300
エスプール	52,900	910.00	48,139,000
WDBホールディングス	9,500	2,519.00	23,930,500
ティア	11,500	430.00	4,945,000
C D G	2,200	1,186.00	2,609,200
アドウェイズ	25,600	608.00	15,564,800
バリューコマース	13,900	2,135.00	29,676,500
インフォマート	190,700	404.00	77,042,800
J Pホールディングス	53,800	294.00	15,817,200
エコナックホールディングス	35,400	91.00	3,221,400
C Lホールディングス	5,400	850.00	4,590,000
プレステージ・インターナショナル	77,400	707.00	54,721,800
アミューズ	10,100	1,751.00	17,685,100
ドリームインキュベータ	5,700	2,611.00	14,882,700
クイック	14,200	2,077.00	29,493,400
T A C	10,500	203.00	2,131,500
電通グループ	192,000	4,460.00	856,320,000
イオンファンタジー	8,000	2,716.00	21,728,000
シーティーエス	20,600	830.00	17,098,000
ネクシィーズグループ	6,100	680.00	4,148,000
H . U . グループホールディングス	53,700	2,806.00	150,682,200
アルプス技研	16,100	1,967.00	31,668,700
日本空調サービス	20,100	704.00	14,150,400
オリエンタルランド	193,700	19,600.00	3,796,520,000
ダスキン	40,900	2,946.00	120,491,400
明光ネットワークジャパン	24,600	612.00	15,055,200
ファルコホールディングス	8,500	1,754.00	14,909,000
ラウンドワン	153,500	624.00	95,784,000
リゾートトラスト	72,400	2,307.00	167,026,800
ビー・エム・エル	22,800	3,310.00	75,468,000
りらいあコミュニケーションズ	30,600	1,032.00	31,579,200
リソー教育	84,300	318.00	26,807,400
早稲田アカデミー	10,400	1,110.00	11,544,000
ユー・エス・エス	188,300	2,176.00	409,740,800

東京個別指導学院	22,300	526.00	11,729,800
サイバーエージェント	438,000	1,122.00	491,436,000
楽天グループ	846,700	663.00	561,362,100
クリーク・アンド・リバー社	10,900	2,086.00	22,737,400
モーニングスター	30,600	448.00	13,708,800
テー・オー・ダブリュー	40,200	306.00	12,301,200
山田コンサルティンググループ	9,600	1,117.00	10,723,200
セントラルスポーツ	7,200	2,368.00	17,049,600
フルキャストホールディングス	17,600	2,922.00	51,427,200
エン・ジャパン	33,200	2,522.00	83,730,400
リソルホールディングス	1,700	4,480.00	7,616,000
テクノプロ・ホールディングス	122,800	3,715.00	456,202,000
アトラグループ	4,100	188.00	770,800
インターワークス	5,600	372.00	2,083,200
アイ・アールジャパンホールディングス	9,700	2,089.00	20,263,300
Keeper 技研	13,300	3,790.00	50,407,000
ファーストロジック	3,300	785.00	2,590,500
三機サービス	3,600	886.00	3,189,600
Gunosy	11,800	668.00	7,882,400
デザインワン・ジャパン	7,100	204.00	1,448,400
イー・ガーディアン	7,000	2,863.00	20,041,000
リブセンス	9,600	283.00	2,716,800
ジャパンマテリアル	56,200	2,193.00	123,246,600
ベクトル	29,000	1,084.00	31,436,000
ウチヤマホールディングス	8,900	289.00	2,572,100
チャーム・ケア・コーポレーション	15,600	1,060.00	16,536,000
キャリアリンク	6,800	2,779.00	18,897,200
I B J	11,500	932.00	10,718,000
アサンテ	9,300	1,610.00	14,973,000
バリューHR	16,200	1,543.00	24,996,600
M&Aキャピタルパートナーズ	17,000	4,405.00	74,885,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,049.00	7,133,200
E R Iホールディングス	5,500	1,050.00	5,775,000
アビスト	3,000	2,883.00	8,649,000
シグマクシス・ホールディングス	28,000	1,246.00	34,888,000
ウィルグループ	15,500	1,355.00	21,002,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	21,500	146.00	3,139,000
メドピア	14,600	1,374.00	20,060,400
レアジョブ	3,800	986.00	3,746,800
リクルートホールディングス	1,354,700	4,494.00	6,088,021,800
エラン	24,500	1,088.00	26,656,000
土木管理総合試験所	8,800	305.00	2,684,000

日本郵政	2,398,400	1,001.00	2,400,798,400
ベルシステム24ホールディングス	24,800	1,317.00	32,661,600
鎌倉新書	21,200	752.00	15,942,400
S MN	5,100	447.00	2,279,700
グローバルキッズCOMPANY	3,400	572.00	1,944,800
エアトリ	11,900	2,444.00	29,083,600
アトラエ	14,600	1,584.00	23,126,400
ストライク	9,100	4,380.00	39,858,000
ソラスト	50,800	848.00	43,078,400
セラク	6,800	1,155.00	7,854,000
インソース	22,800	3,385.00	77,178,000
ベйкаレント・コンサルティング	145,000	4,160.00	603,200,000
Orchestra Holdings	4,000	2,558.00	10,232,000
アイモバイル	9,800	1,221.00	11,965,800
キャリアインデックス	7,100	388.00	2,754,800
MS - Japan	6,400	851.00	5,446,400
船場	3,500	763.00	2,670,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	65,200	1,658.00	108,101,600
フルテック	2,900	1,072.00	3,108,800
GameWith	6,400	370.00	2,368,000
MS&Consulting	2,700	606.00	1,636,200
ウェルビー	13,800	903.00	12,461,400
エル・ティー・エス	2,400	2,982.00	7,156,800
ミダックホールディングス	11,200	3,605.00	40,376,000
日総工産	14,300	558.00	7,979,400
キュービーネットホールディングス	9,800	1,288.00	12,622,400
RPAホールディングス	25,900	281.00	7,277,900
スプリックス	6,600	1,038.00	6,850,800
マネジメントソリューションズ	10,200	3,165.00	32,283,000
プロレド・パートナーズ	5,100	523.00	2,667,300
テノ・ホールディングス	2,800	531.00	1,486,800
フロンティア・マネジメント	6,400	1,301.00	8,326,400
ピアラ	3,500	682.00	2,387,000
コプロ・ホールディングス	3,400	911.00	3,097,400
ギークス	2,900	770.00	2,233,000
カーブスホールディングス	56,600	907.00	51,336,200
フォーラムエンジニアリング	11,600	832.00	9,651,200
Fast Fitness Japan	6,500	1,493.00	9,704,500
ダイレクトマーケティングミックス	21,000	1,653.00	34,713,000
ポピンズ	2,900	1,552.00	4,500,800
LITALICO	14,300	2,375.00	33,962,500
アドバンテッジリスクマネジメント	9,100	420.00	3,822,000



リログループ	102,000	2,068.00	210,936,000	
東祥	13,100	1,177.00	15,418,700	
ビーウィズ	5,800	1,214.00	7,041,200	
TREホールディングス	38,700	1,528.00	59,133,600	
人・夢・技術グループ	8,300	2,670.00	22,161,000	
エイチ・アイ・エス	48,000	1,963.00	94,224,000	
ラックランド	5,800	2,914.00	16,901,200	
共立メンテナンス	31,400	5,910.00	185,574,000	
イチネンホールディングス	19,700	1,234.00	24,309,800	
建設技術研究所	9,500	2,895.00	27,502,500	
スペース	13,700	887.00	12,151,900	
燦ホールディングス	8,300	1,712.00	14,209,600	
スバル興業	1,200	8,740.00	10,488,000	
東京テアトル	6,700	1,105.00	7,403,500	
タナベコンサルティンググループ	7,600	620.00	4,712,000	
ナガワ	5,100	6,850.00	34,935,000	
東京都競馬	15,400	3,965.00	61,061,000	
カナモト	33,700	2,304.00	77,644,800	
西尾レントオール	17,100	3,105.00	53,095,500	
トランス・コスモス	22,800	3,110.00	70,908,000	
乃村工藝社	80,100	1,034.00	82,823,400	
藤田観光	8,100	2,947.00	23,870,700	
KNT-CTホールディングス	10,900	1,644.00	17,919,600	
日本管財	19,400	2,500.00	48,500,000	
トーカイ	16,400	1,887.00	30,946,800	
セコム	186,400	8,237.00	1,535,376,800	
セントラル警備保障	10,000	2,527.00	25,270,000	
丹青社	35,900	795.00	28,540,500	
メイテック	73,100	2,521.00	184,285,100	
応用地質	17,900	2,382.00	42,637,800	
船井総研ホールディングス	38,600	2,660.00	102,676,000	
進学会ホールディングス	7,100	302.00	2,144,200	
オオバ	12,000	679.00	8,148,000	
いであ	4,300	1,672.00	7,189,600	
学究社	7,500	1,683.00	12,622,500	
ベネッセホールディングス	68,500	1,971.00	135,013,500	
イオンディライト	20,400	2,936.00	59,894,400	
ナック	9,200	924.00	8,500,800	
ダイセキ	37,400	4,595.00	171,853,000	
ステップ	7,700	1,867.00	14,375,900	
合 計	206,872,000		497,848,364,840	

## (2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	12,230,026,295
コール・ローン	456,852,882
株式	529,770,777,353
投資信託受益証券	240,883,146
投資証券	12,033,440,055
派生商品評価勘定	235,022,440
未収入金	311,177
未収配当金	481,302,701
前払金	405,108,454
差入委託証拠金	2,887,922,769
流動資産合計	558,741,647,272
資産合計	558,741,647,272
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	640,463,779
未払解約金	360,394,242
未払利息	1,031
流動負債合計	1,000,859,052
負債合計	1,000,859,052
純資産の部	
元本等	
元本	127,933,121,209
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	429,807,667,011
元本等合計	557,740,788,220
純資産合計	557,740,788,220
負債純資産合計	558,741,647,272

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引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>

	2022年11月10日現在
	<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 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 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11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	127,933,121,209口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 4.3596円 (1万口当たり純資産額) (43,596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11月10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	<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	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11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

元本の移動

区分	2022年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月11日

区分	2022年11月10日現在
期首元本額	123,439,506,128円
期中追加設定元本額	10,307,146,626円
期中一部解約元本額	5,813,531,545円
期末元本額	127,933,121,209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）	1,851,771,282円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,408,011円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	33,199,734,257円
世界経済インデックスファンド	11,686,360,544円
外国株式インデックス・オープン	896,202,179円
D C マイセレクション 2 5	791,147,576円
D C マイセレクション 5 0	3,646,279,765円
D C マイセレクション 7 5	4,353,554,537円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,186,231,445円
D C マイセレクション S 2 5	406,897,835円
D C マイセレクション S 5 0	1,868,842,937円
D C マイセレクション S 7 5	1,627,967,215円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	35,134,455円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	149,914,052円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	112,439,180円
D C 世界経済インデックスファンド	10,044,695,233円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,289,060,214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）	26,224,108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）	43,298,483円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	10,651,748円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	29,354,759円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	232,450,276円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	160,616,886円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	1,181,622,749円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	87,885,841円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	22,295,726円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	148,476,737円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	48,232,754円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	966,793,660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）	1,046,541,005円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,174,517,995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	1,541,300,012円

区分	2022年11月10日現在
分散投資コア戦略ファンドS	8,275,998,160円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,380,137,788円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,147,062,242円
コア投資戦略ファンド(切替型)	546,672,331円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	583,928,096円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	29,188,361円
SMT インデックスバランス・オープン	156,394,950円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	351,845,759円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	15,768,253,729円
SMT 世界経済インデックス・オープン	214,865,221円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	822,719,782円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	152,342,156円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,307,762円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	309,491,845円
グローバル経済コア	641,332,210円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	14,311,077円
DCターゲット・イヤーフンド2055	5,542,899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	53,691,750円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	47,284,347円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	18,403,713円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	22,439,568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)	234,706,572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)	168,621,815円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	799,940,045円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,349,859,838円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	217,929,099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)	77,921,821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)	73,791,279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11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	49,551,107,078	
投資信託受益証券	69,693,319	
投資証券	2,810,115,037	
合計	52,430,915,434	

(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11月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	15,970,628,859	-	15,565,520,405	405,108,454
合計		15,970,628,859	-	15,565,520,405	405,108,454

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

#### 通貨関連

(2022年11月10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	55,609,600	-	55,277,135	332,465
	ユーロ	21,997,800	-	21,994,875	2,925
	イギリスポンド	33,611,800	-	33,282,260	329,540
	売建	14,113,215	-	14,113,635	420
	オーストラリアドル	14,113,215	-	14,113,635	420
合計		69,722,815	-	69,390,770	332,885

(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	45.55	1,260,414.05	
	BAKER HUGHES CO	75,948	29.51	2,241,225.48	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	162.87	2,971,237.41	
	CHEVRON CORP	153,061	177.93	27,234,143.73	
	CONOCOPHILLIPS	105,873	125.26	13,261,651.98	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	26.74	1,711,360.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	66.76	3,355,090.56	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	157.55	2,090,215.85	
	EOG RESOURCES INC	47,936	139.62	6,692,824.32	
	EQT CORPORATION	27,026	40.84	1,103,741.84	
	EXXON MOBIL	343,717	108.90	37,430,781.30	
	HALLIBURTON CO	71,583	36.81	2,634,970.23	
	HESS CORP	22,781	137.71	3,137,171.51	
	KINDER MORGAN INC	168,208	17.58	2,957,096.64	
	MARATHON OIL CORP	57,281	30.63	1,754,517.03	
	MARATHON PETROLEUM CORP	45,012	115.86	5,215,090.32	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	77,357	67.93	5,254,861.01	
	ONEOK INC	35,533	60.86	2,162,538.38	
	PHILLIPS 66	38,237	104.09	3,980,089.33	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,998	241.74	4,592,576.52	
	SCHLUMBERGER	112,526	53.07	5,971,754.82	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	68.31	1,181,626.38	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	2,611.65	1,392,009.45	
	VALERO ENERGY CORP	32,597	128.00	4,172,416.00	
	WILLIAMS COS	98,553	32.67	3,219,726.51	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,324	280.13	5,133,102.12	
	ALBEMARLE CORP	9,440	300.13	2,833,227.20	
	ALCOA CORP	15,500	40.68	630,540.00	
AMCOR PLC	126,534	11.02	1,394,404.68		
AVERY DENNISON CORP	6,638	170.60	1,132,442.80		
BALL CORP	25,605	49.55	1,268,727.75		

CELANESE CORP-SERIES A	8,582	91.75	787,398.50
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	104.66	1,729,715.82
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	13.05	561,150.00
CORTEVA INC	58,500	67.05	3,922,425.00
CROWN HOLDINGS INC	9,940	72.22	717,866.80
DOW INC	60,585	47.68	2,888,692.80
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	67.03	2,746,889.40
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	79.20	877,140.00
ECOLAB INC	21,208	140.65	2,982,905.20
FMC CORP	10,507	125.87	1,322,516.09
FREEMONT-MCMORAN INC	119,600	34.03	4,069,988.00
INT'L PAPER CO	30,800	33.22	1,023,176.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,024	91.58	1,925,377.92
LINDE PLC	41,106	314.44	12,925,370.64
LYONDELLBASELL INDU-CL A	21,835	80.10	1,748,983.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,192	336.53	1,747,263.76
MOSAIC CO/THE	27,732	49.63	1,376,339.16
NEWMONT CORPORATION	65,704	43.33	2,846,954.32
NUCOR CORP	22,299	131.07	2,922,729.93
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	120.01	922,516.87
PPG INDUSTRIES INC	19,278	114.18	2,201,162.04
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	94.75	990,706.00
SEALED AIR CORP	11,690	46.11	539,025.90
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	222.00	4,377,618.00
STEEL DYNAMICS INC	15,552	92.05	1,431,561.60
VULCAN MATERIALS CO	10,247	168.94	1,731,128.18
WESTLAKE CORP	4,100	97.02	397,782.00
WESTROCK CO	21,356	34.54	737,636.24
3 M COMPANY	46,618	123.83	5,772,706.94
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	56.01	616,390.05
ALLEGION PLC	7,601	104.37	793,316.37
AMETEK INC	19,255	135.69	2,612,710.95
BOEING CO	46,285	168.74	7,810,130.90
CARLISLE COS INC	4,378	229.70	1,005,626.60
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	40.34	2,749,493.72
CATERPILLAR	43,701	225.54	9,856,323.54
CUMMINS INC	11,214	237.69	2,665,455.66
DEERE&CO	23,765	397.09	9,436,843.85
DOVER CORP	12,041	130.21	1,567,858.61
EATON CORP	32,650	156.30	5,103,195.00
EMERSON ELECTRIC CO	48,687	90.12	4,387,672.44
FASTENAL CO	47,949	48.88	2,343,747.12

FORTIVE CORP	28,348	64.34	1,823,910.32
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	58.12	599,217.20
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	96.97	505,310.67
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	249.52	4,733,394.40
GENERAL ELECTRIC CO	89,763	83.15	7,463,793.45
GRAINGER (WW) INC	3,667	591.01	2,167,233.67
HEICO CORP	3,640	156.04	567,985.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	121.88	786,004.12
HONEYWELL INTL INC	55,841	208.63	11,650,107.83
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	36.34	1,148,125.96
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	238.79	841,018.38
IDEX CORP	5,916	221.79	1,312,109.64
ILLINOIS TOOL WORKS	25,708	211.62	5,440,326.96
INGERSOLL-RAND INC	31,562	51.73	1,632,702.26
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	47.52	603,504.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	63.85	3,619,592.65
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	237.67	3,727,616.28
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	236.29	596,868.54
LOCKHEED MARTIN CORP	19,579	485.18	9,499,339.22
MASCO CORP	19,462	45.05	876,763.10
NORDSON CORP	4,121	223.70	921,867.70
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,122	533.14	6,462,723.08
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	72.61	2,458,429.38
OWENS CORNING	8,642	83.99	725,841.58
PACCAR INC	28,106	99.76	2,803,854.56
PARKER HANNIFIN CORP	10,579	289.23	3,059,764.17
PENTAIR PLC	14,533	40.59	589,894.47
PLUG POWER INC	41,884	14.61	611,925.24
QUANTA SERVICES INC	11,465	143.04	1,639,953.60
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	121,485	95.13	11,556,868.05
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	253.45	2,305,888.10
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	41.03	567,362.84
SMITH (A.O.) CORP	9,016	55.05	496,330.80
SNAP-ON INC	4,000	227.37	909,480.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	73.86	930,488.28
TEXTRON	16,934	68.30	1,156,592.20
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	165.75	3,089,248.50
TRANSDIGM GROUP INC	4,347	582.80	2,533,431.60
UNITED RENTALS INC	6,022	317.68	1,913,068.96
WABTEC CORP	15,024	96.48	1,449,515.52
XYLEM INC	15,077	105.35	1,588,361.95
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	109.94	1,249,358.16

CINTAS CORP	7,423	420.03	3,117,882.69
CLARIVATE PLC	27,357	9.20	251,684.40
COPART INC	33,234	55.67	1,850,136.78
COSTAR GROUP INC	32,116	79.78	2,562,214.48
EQUIFAX INC	9,509	165.12	1,570,126.08
JACOBS SOLUTIONS INC	10,661	116.99	1,247,230.39
LEIDOS HOLDINGS	11,220	106.81	1,198,408.20
REPUBLIC SERVICES INC	18,296	132.07	2,416,352.72
ROBERT HALF INTL INC	9,566	74.11	708,936.26
ROLLINS INC	17,468	41.55	725,795.40
TRANSUNION	15,741	54.40	856,310.40
VERISK ANALYTICS INC	13,315	169.87	2,261,819.05
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	137.67	2,928,929.25
WASTE MANAGEMENT INC	33,891	158.20	5,361,556.20
AMERCO	734	513.47	376,886.98
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	90.31	928,115.87
CSX CORP	179,261	29.43	5,275,651.23
DELTA AIR LINES INC	14,609	33.46	488,817.14
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	104.78	1,495,420.16
FEDEX CORP	20,314	158.04	3,210,424.56
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	2.59	214,998.49
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	170.65	1,203,423.80
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,697	47.50	650,607.50
LYFT INC-A	21,288	10.64	226,504.32
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	230.54	4,400,316.98
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	281.86	2,255,725.58
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	37.20	503,427.60
UBER TECHNOLOGIES INC	120,334	26.55	3,194,867.70
UNION PACIFIC CORP	51,838	203.41	10,544,367.58
UNITED PARCEL SERVICE B	59,627	164.01	9,779,424.27
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	23.17	166,244.75
APTIV PLC	22,415	97.47	2,184,790.05
BORGWARNER INC	19,781	38.54	762,359.74
FORD MOTOR COMPANY	321,972	13.31	4,285,447.32
GENERAL MOTORS CO	114,534	38.06	4,359,164.04
LEAR CORP	5,287	135.84	718,186.08
LUCID GROUP INC	31,234	11.21	350,133.14
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	26,935	28.07	756,065.45
TESLA INC	216,377	177.59	38,426,391.43
DR HORTON INC	27,764	75.44	2,094,516.16
GARMIN LTD	12,854	85.58	1,100,045.32
HASBRO INC	10,572	57.96	612,753.12

LENNAR CORP-CL A	20,844	78.53	1,636,879.32
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	321.21	2,988,859.05
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	89.31	371,797.53
NEWELL BRANDS INC	31,461	12.58	395,779.38
NIKE B	103,874	92.10	9,566,795.40
NVR INC	247	4,071.94	1,005,769.18
PULTE GROUP INC	21,609	38.58	833,675.22
VF CORP	25,718	26.90	691,814.20
WHIRLPOOL CORP	5,220	138.05	720,621.00
AIRBNB INC-CLASS A	31,141	95.79	2,982,996.39
ARAMARK	20,955	35.94	753,122.70
BOOKING HOLDINGS INC	3,339	1,865.82	6,229,972.98
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	42.96	754,377.60
CARNIVAL CORPORATION	84,361	8.56	722,130.16
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,303	1,375.82	3,168,513.46
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	139.65	1,495,930.80
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	338.54	964,161.92
EXPEDIA GROUP INC	11,638	89.06	1,036,480.28
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	129.89	2,841,733.42
LAS VEGAS SANDS CORP	29,096	39.95	1,162,385.20
MARRIOTT INTL A	22,091	149.57	3,304,150.87
MCDONALD'S CORP	60,458	277.79	16,794,627.82
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	33.56	969,011.44
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	52.53	880,770.51
STARBUCKS CORP	93,796	91.63	8,594,527.48
VAIL RESORTS INC	3,014	215.97	650,933.58
WYNN RESORTS LTD	9,302	68.28	635,140.56
YUM BRANDS INC	22,637	122.05	2,762,845.85
ACTIVISION BLIZZARD INC	64,558	71.66	4,626,226.28
ALPHABET INC-CL A	492,726	87.32	43,024,834.32
ALPHABET INC-CL C	460,933	87.40	40,285,544.20
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	5.19	198,725.10
CABLE ONE INC	445	620.99	276,340.55
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	349.88	3,431,972.92
COMCAST CORP-CL A	367,926	31.39	11,549,197.14
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	14.15	284,867.80
ELECTRONIC ARTS INC	23,158	126.29	2,924,623.82
FOX CORP - CLASS A	27,658	28.44	786,593.52
FOX CORP- CLASS B	10,345	26.66	275,797.70
IAC INC	6,721	43.87	294,850.27
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	29.90	1,011,636.60
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	79.92	900,538.56

LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	58.49	899,517.71
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	42.92	583,025.28
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	43.04	274,767.36
LIVE NATION ENTERTAINMENT	14,491	72.64	1,052,626.24
MATCH GROUP INC	22,730	42.94	976,026.20
META PLATFORMS INC-CLASS A	187,450	101.47	19,020,551.50
NETFLIX INC	36,196	254.66	9,217,673.36
NEWS CORP-CLASS A	33,479	16.16	541,020.64
OMNICOM GROUP	16,538	73.36	1,213,227.68
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	15.53	754,540.58
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	21.28	973,921.76
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	30.92	867,584.28
ROKU INC	9,122	48.11	438,859.42
SEA LTD-ADR	28,338	40.92	1,159,590.96
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.32	382,157.76
SNAP INC - A	83,375	9.56	797,065.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	94.09	1,210,656.03
THE WALT DISNEY CO	149,471	86.75	12,966,609.25
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	39.89	1,462,806.19
WARNER BROS DISCOVERY INC	192,233	9.84	1,891,572.72
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	28.07	615,715.45
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	175.35	933,563.40
AMAZON.COM	749,309	86.14	64,545,477.26
AUTOZONE INC	1,639	2,464.89	4,039,954.71
BATH & BODY WORKS INC	19,806	30.90	612,005.40
BEST BUY COMPANY INC	18,175	67.30	1,223,177.50
BURLINGTON STORES INC	5,108	133.76	683,246.08
CARMAX INC	13,591	64.66	878,794.06
CHEWY INC - CLASS A	6,878	31.99	220,027.22
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	242.36	4,528,738.96
DOLLAR TREE INC	17,931	154.88	2,777,153.28
DOORDASH INC - A	15,171	53.25	807,855.75
EBAY	46,820	40.57	1,899,487.40
ETSY INC	10,294	94.96	977,518.24
GENUINE PARTS CO	11,319	178.38	2,019,083.22
HOME DEPOT	84,000	286.75	24,087,000.00
LKQ CORP	22,779	52.25	1,190,202.75
LOWES COMPANIES	52,525	186.63	9,802,740.75
MERCADOLIBRE INC	3,725	897.62	3,343,634.50
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	828.70	4,480,780.90
POOL CORP	3,304	300.40	992,521.60
ROSS STORES INC	28,076	91.32	2,563,900.32

TARGET (DAYTON HUDSON)	37,926	152.99	5,802,298.74
TJX COMPANIES INC	97,454	70.08	6,829,576.32
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	203.40	1,814,734.80
ULTA BEAUTY INC	4,315	413.47	1,784,123.05
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	28.75	172,500.00
COSTCO WHOLESALE CORP	36,343	489.97	17,806,979.71
KROGER CO	56,126	48.06	2,697,415.56
SYSCO CORP	42,228	82.96	3,503,234.88
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	36.89	2,204,804.63
WALMART INC	124,048	139.47	17,300,974.56
ALTRIA GROUP INC	148,393	45.21	6,708,847.53
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	46,575	93.06	4,334,269.50
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	66.44	1,594,958.64
BUNGE LIMITED	11,604	99.93	1,159,587.72
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	51.44	816,301.36
COCA-COLA CO	337,769	58.77	19,850,684.13
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	49.02	754,613.88
CONAGRA BRANDS INC	40,304	35.53	1,432,001.12
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	239.79	3,102,882.60
GENERAL MILLS INC	49,534	80.34	3,979,561.56
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	230.72	2,773,023.68
HORMEL FOODS CORP	23,338	47.14	1,100,153.32
JM SMUCKER CO	9,145	147.63	1,350,076.35
KELLOGG CO	21,630	71.00	1,535,730.00
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	37.57	2,335,163.35
KRAFT HEINZ CO/THE	58,511	37.73	2,207,620.03
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	79.21	1,646,775.90
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	49.76	729,929.44
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	113,286	63.39	7,181,199.54
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	96.23	3,105,053.41
PEPSICO INC	113,421	178.55	20,251,319.55
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	126,117	90.97	11,472,863.49
TYSON FOODS INC	23,306	64.11	1,494,147.66
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	72.53	1,403,165.38
CLOROX COMPANY	9,570	140.28	1,342,479.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	65,702	73.46	4,826,468.92
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,016	204.81	3,894,666.96
KIMBERLY-CLARK CORP	26,841	123.83	3,323,721.03
PROCTER & GAMBLE CO	196,677	136.48	26,842,476.96
ABBOTT LABORATORIES	143,383	99.46	14,260,873.18
ABIOMED INC	3,781	374.00	1,414,094.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	174.58	1,037,528.94

AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	158.19	2,040,018.24
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	51.65	2,066,671.45
BECTON DICKINSON & CO	23,274	218.29	5,080,481.46
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,818	42.06	4,913,365.08
CARDINAL HEALTH	21,902	80.17	1,755,883.34
CENTENE CORP	48,335	83.88	4,054,339.80
CIGNA CORP	26,188	324.99	8,510,838.12
CVS HEALTH CORP	106,862	99.56	10,639,180.72
DAVITA INC	4,627	65.42	302,698.34
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	28.74	510,824.76
DEXCOM INC	32,658	113.15	3,695,252.70
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	51,357	69.99	3,594,476.43
ELEVANCE HEALTH INC	19,661	520.00	10,223,720.00
HCA HEALTHCARE INC	19,440	209.01	4,063,154.40
HENRY SCHEIN INC	11,747	74.43	874,329.21
HOLOGIC INC	19,018	72.11	1,371,387.98
HUMANA INC	10,365	553.47	5,736,716.55
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	379.88	2,564,569.88
INSULET CORP	5,311	294.93	1,566,373.23
INTUITIVE SURGICAL INC	29,197	236.13	6,894,287.61
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	230.54	1,750,951.30
MASIMO CORP	4,147	110.88	459,819.36
MCKESSON CORP	12,089	386.22	4,669,013.58
MEDTRONIC PLC	109,343	79.29	8,669,806.47
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	326.80	1,485,306.00
NOVOCURE LTD	7,933	69.22	549,122.26
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	145.42	1,454,927.10
RESMED INC	12,169	211.96	2,579,341.24
STERIS PLC	8,018	160.98	1,290,737.64
STRYKER CORP	28,067	207.16	5,814,359.72
TELADOC HEALTH INC	11,375	26.76	304,395.00
TELEFLEX INC	3,934	200.45	788,570.30
THE COOPER COS INC	4,134	273.57	1,130,938.38
UNITEDHEALTH GROUP INC	76,869	540.66	41,559,993.54
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	111.68	681,471.36
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	170.60	1,920,103.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	105.77	1,722,041.37
ABBVIE INC	144,953	147.62	21,397,961.86
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	137.00	3,258,545.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	197.94	1,908,735.42
AMGEN	43,905	289.65	12,717,083.25
AVANTOR INC	48,633	19.62	954,179.46



BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	403.49	747,666.97
BIO-TECHNE CORP	3,245	313.06	1,015,879.70
BIOGEN INC	11,860	282.31	3,348,196.60
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	80.93	1,196,388.19
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	173,351	79.78	13,829,942.78
CATALENT INC	13,739	41.51	570,305.89
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	221.09	929,462.36
DANAHER CORP	56,691	246.95	13,999,842.45
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	12.06	434,895.66
EXACT SCIENCES CORP	14,756	40.26	594,076.56
GILEAD SCIENCES INC	103,360	82.32	8,508,595.20
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	74.96	1,343,732.96
ILLUMINA INC	12,506	215.85	2,699,420.10
INCYTE CORP	15,212	77.22	1,174,670.64
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	204.31	3,090,393.06
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	140.00	695,940.00
JOHNSON & JOHNSON	215,641	172.45	37,187,290.45
LILLY (ELI) & CO	66,242	363.27	24,063,731.34
MERCK & CO	207,468	101.59	21,076,674.12
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,336.23	2,415,903.84
MODERNA INC	27,309	163.21	4,457,101.89
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	122.39	1,037,132.86
PERKINELMER INC	10,545	126.29	1,331,728.05
PFIZER	460,155	46.72	21,498,441.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,915	742.95	6,623,399.25
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	43.03	1,124,287.84
SEAGEN INC	10,981	137.96	1,514,938.76
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	9.08	836,640.28
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,118	484.71	15,567,915.78
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,811	309.34	6,437,674.74
VIATRIS INC	90,748	10.83	982,800.84
WATERS CORP	4,749	309.52	1,469,910.48
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	221.51	1,277,448.17
ZOETIS INC	38,534	133.17	5,131,572.78
BANK OF AMERICA CORP	591,261	36.52	21,592,851.72
CITIGROUP	158,792	45.36	7,202,805.12
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	39.66	1,567,442.52
FIFTH THIRD BANCORP	57,420	34.48	1,979,841.60
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	821.90	780,805.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,984	112.21	1,681,354.64
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	14.98	1,709,397.76
JPMORGAN CHASE & CO	240,076	129.74	31,147,460.24

KEY CORP	71,472	17.90	1,279,348.80
M & T BANK CORP	14,929	165.94	2,477,318.26
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,513	155.55	5,368,497.15
REGIONS FINL CORP	79,314	22.46	1,781,392.44
SIGNATURE BANK	4,686	132.02	618,645.72
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	208.30	946,723.50
TRUIST FINANCIAL CORP	109,883	42.69	4,690,905.27
US BANCORP	116,467	43.24	5,036,033.08
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	53.96	770,171.08
WELLS FARGO & CO	310,526	45.97	14,274,880.22
ALLY FINANCIAL INC	27,761	24.84	689,583.24
AMERICAN EXPRESS	52,626	145.86	7,676,028.36
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	315.01	2,741,217.02
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	61.01	1,943,412.54
BANK NEW YORK CO	61,254	42.10	2,578,793.40
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,127	288.65	30,344,908.55
BLACKROCK INC	12,394	669.62	8,299,270.28
BLACKSTONE INC	57,841	89.99	5,205,111.59
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	101.47	3,374,486.32
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	26.04	408,020.76
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	123.26	1,093,932.50
CME GROUP INC	29,373	171.00	5,022,783.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	45.98	440,304.48
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	100.04	2,341,236.12
EQUITABLE HOLDINGS INC	34,355	29.26	1,005,227.30
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	418.18	1,316,430.64
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	22.70	591,789.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	38.61	166,640.76
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,241	362.00	10,223,242.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	97.26	4,347,813.78
INVESCO LTD	26,420	15.91	420,342.20
KKR & CO INC	44,282	50.50	2,236,241.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	258.11	1,648,290.46
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	251.92	807,907.44
MOODY'S CORP	13,365	262.48	3,508,045.20
MORGAN STANLEY	107,356	83.45	8,958,858.20
MSCI INC	6,518	465.13	3,031,717.34
NASDAQ INC	28,971	63.61	1,842,845.31
NORTHERN TRUST CORP	15,902	84.00	1,335,768.00
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	107.12	1,918,197.84
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	121.52	1,881,858.72
S&P GLOBAL INC	28,338	314.10	8,900,965.80

SCHWAB (CHARLES) CORP	118,155	78.27	9,247,991.85
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	55.80	532,890.00
STATE STREET CORP	30,359	75.22	2,283,603.98
SYNCHRONY FINANCIAL	41,566	35.01	1,455,225.66
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	56.42	511,221.62
AFLAC	50,591	67.52	3,415,904.32
ALLSTATE CORP	22,174	127.94	2,836,941.56
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	145.87	921,752.53
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	58.46	3,852,397.08
AON PLC	17,038	281.10	4,789,381.80
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	57.56	1,711,028.56
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,431	188.58	3,287,137.98
ASSURANT INC	4,726	122.62	579,502.12
BROWN & BROWN INC	19,873	55.73	1,107,522.29
CHUBB LTD	34,810	210.12	7,314,277.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	101.49	1,298,158.59
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	262.86	569,354.76
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	320.04	1,052,291.52
FNF GROUP	20,461	38.70	791,840.70
GLOBE LIFE INC	8,106	112.50	911,925.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	71.91	1,993,417.11
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	32.81	442,410.04
LOEWS CORP	16,741	54.46	911,714.86
MARKEL CORP	1,156	1,215.26	1,404,840.56
MARSH & MCLENNAN COS	41,045	159.31	6,538,878.95
METLIFE INC	57,127	72.77	4,157,131.79
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	89.47	1,853,728.93
PROGRESSIVE CORP	48,534	127.70	6,197,791.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,146	102.42	3,189,973.32
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	182.15	3,601,469.80
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,385	223.48	2,097,359.80
WR BERKLEY CORP	17,572	73.61	1,293,474.92
CBRE GROUP INC-A	27,714	70.10	1,942,751.40
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.13	407,631.00
WEYERHAEUSER CO	64,295	30.06	1,932,707.70
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	32.14	431,543.78
ACCENTURE PLC-CL A	51,987	266.44	13,851,416.28
ADOBE INC	38,782	298.87	11,590,776.34
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	12.10	155,073.60
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	89.08	1,217,990.84
ANSYS INC	6,794	225.60	1,532,726.40
APPROVIN CORP-CLASS A	10,000	13.74	137,400.00

AUTODESK INC	17,467	194.61	3,399,252.87
AUTOMATIC DATA PROCESS	34,246	240.38	8,232,053.48
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	34.43	481,882.28
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	99.36	739,536.48
BLACK KNIGHT INC	11,543	56.09	647,446.87
BLOCK INC	41,288	57.21	2,362,086.48
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	133.74	1,302,895.08
CADENCE DESIGN SYSTEMS	22,740	147.76	3,360,062.40
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	55.52	592,287.36
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	127.43	1,035,241.32
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	37.84	767,508.72
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	43,220	54.02	2,334,744.40
COUPA SOFTWARE INC	6,059	42.17	255,508.03
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,831	122.36	2,059,441.16
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	145.46	450,926.00
DATADOG INC - CLASS A	20,137	67.22	1,353,609.14
DOCUSIGN INC	14,969	39.80	595,766.20
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	21.19	488,810.92
DYNATRACE INC	14,790	34.13	504,782.70
EPAM SYSTEMS INC	4,779	307.29	1,468,538.91
FAIR ISAAC CORP	2,125	443.77	943,011.25
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	49,912	61.72	3,080,568.64
FISERV INC	49,921	96.18	4,801,401.78
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	178.96	1,074,117.92
FORTINET INC	56,318	49.88	2,809,141.84
GARTNER INC	6,340	323.73	2,052,448.20
GEN DIGITAL INC	43,549	22.92	998,143.08
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	96.83	2,185,162.61
GODADDY INC - CLASS A	13,798	68.81	949,440.38
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	52.65	332,642.70
HUBSPOT INC	3,646	259.36	945,626.56
INTL BUSINESS MACHINES CORP	73,262	137.39	10,065,466.18
INTUIT INC	21,909	368.55	8,074,561.95
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	172.52	1,085,323.32
MASTERCARD INC-CLASS A	70,879	315.64	22,372,247.56
MICROSOFT CORP	581,193	224.51	130,483,640.43
MONGODB INC	5,325	137.35	731,388.75
OKTA INC	11,505	45.51	523,592.55
ORACLE CORP	130,499	75.66	9,873,554.34
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	6.98	874,203.12
PALO ALTO NETWORKS INC	24,237	151.57	3,673,602.09
PAYCHEX INC	26,693	115.24	3,076,101.32

PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	299.51	1,268,424.85
PAYPAL HOLDINGS INC	90,208	78.68	7,097,565.44
PTC INC	9,804	125.83	1,233,637.32
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	28.36	181,305.48
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,672	416.20	3,609,286.40
SALESFORCE INC	81,603	142.06	11,592,522.18
SERVICENOW INC	16,309	361.27	5,891,952.43
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,680	126.26	2,232,276.80
SPLUNK INC	13,355	71.89	960,090.95
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	49.32	953,602.20
SYNOPSYS INC	12,539	290.08	3,637,313.12
TWILIO INC - A	12,842	43.60	559,911.20
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	292.02	975,054.78
UNITY SOFTWARE INC	16,329	21.50	351,073.50
VERISIGN INC	7,790	178.32	1,389,112.80
VISA INC-CLASS A SHARES	134,653	193.93	26,113,256.29
VMWARE INC-CLASS A	16,717	110.53	1,847,730.01
WESTERN UNION CO	29,297	12.68	371,485.96
WIX.COM LTD	5,010	69.52	348,295.20
WORKDAY INC-CLASS A	16,567	134.95	2,235,716.65
ZENDESK INC	8,890	76.40	679,196.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19,002	71.84	1,365,103.68
ZSCALER INC	7,204	116.25	837,465.00
AMPHENOL CORPORATION	47,707	74.48	3,553,217.36
APPLE INC	1,323,830	134.87	178,544,952.10
ARISTA NETWORKS INC	20,350	122.92	2,501,422.00
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	103.26	629,886.00
CDW CORP/DE	10,882	172.09	1,872,683.38
CISCO SYSTEMS	337,789	43.91	14,832,314.99
COGNEX CORP	14,352	45.94	659,330.88
CORNING	64,989	32.06	2,083,547.34
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	39.33	884,177.73
F5 INC	4,851	134.25	651,246.75
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,530	14.15	1,549,849.50
HP INC	83,910	27.80	2,332,698.00
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	28.94	732,789.74
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	161.02	2,413,528.78
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,836	253.62	3,509,086.32
NETAPP INC	18,303	68.01	1,244,787.03
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	50.59	838,933.97
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	114.20	2,976,965.60
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	405.36	1,580,498.64

TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	54.05	1,144,562.80
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	34.35	885,886.50
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	226.88	944,274.56
AT&T INC	581,626	18.38	10,690,285.88
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	18.33	284,408.28
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	19.08	524,451.96
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	6.33	466,957.77
T-MOBILE US INC	50,968	148.64	7,575,883.52
VERIZON COMMUNICATIONS	344,746	37.62	12,969,344.52
AES CORP	54,375	26.25	1,427,343.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	53.34	1,108,298.52
AMEREN CORPORATION	20,898	81.57	1,704,649.86
AMERICAN ELECTRIC POWER	42,467	87.82	3,729,451.94
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,165	139.46	2,114,910.90
ATMOS ENERGY CORP	10,802	103.15	1,114,226.30
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	28.19	1,357,686.78
CMS ENERGY CORP	23,697	56.22	1,332,245.34
CONSOLIDATED EDISON INC	29,197	87.67	2,559,700.99
CONSTELLATION ENERGY	25,732	87.35	2,247,690.20
DOMINION ENERGY INC	66,909	60.42	4,042,641.78
DTE ENERGY COMPANY	15,851	110.77	1,755,815.27
DUKE ENERGY CORP	62,802	93.45	5,868,846.90
EDISON INTL	30,339	57.31	1,738,728.09
ENERGY CORP	16,181	107.12	1,733,308.72
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	43.81	893,680.19
EVERGY INC	18,475	60.13	1,110,901.75
EVERSOURCE ENERGY	28,450	74.91	2,131,189.50
EXELON CORP	81,218	37.69	3,061,106.42
FIRSTENERGY CORP	45,165	37.18	1,679,234.70
NEXTERA ENERGY INC	159,643	78.20	12,484,082.60
NISOURCE INC	32,351	24.89	805,216.39
NRG ENERGY INC	19,068	42.65	813,250.20
PG&E CORP	118,132	14.58	1,722,364.56
PPL CORPORATION	58,459	26.68	1,559,686.12
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	57.27	2,260,332.36
SEMPRA ENERGY	25,885	150.07	3,884,561.95
SOUTHERN CO	86,558	63.44	5,491,239.52
UGI CORP	18,019	35.19	634,088.61
VISTRA CORP	31,797	23.55	748,819.35
WEC ENERGY GROUP INC	26,033	90.35	2,352,081.55
XCEL ENERGY INC	43,741	65.61	2,869,847.01
ADVANCED MICRO DEVICES	132,978	59.92	7,968,041.76

	ANALOG DEVICES	42,691	148.23	6,328,086.93
	APPLIED MATERIALS	72,040	94.38	6,799,135.20
	BROADCOM INC	32,989	469.47	15,487,345.83
	ENPHASE ENERGY INC	11,020	284.75	3,137,945.00
	ENTEGRIS INC	12,483	64.84	809,397.72
	INTEL CORP	336,001	27.52	9,246,747.52
	KLA CORP	12,119	337.52	4,090,404.88
	LAM RESEARCH CORP	11,398	432.74	4,932,370.52
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,444	36.71	2,585,999.24
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	66.50	2,945,218.50
	MICRON TECHNOLOGY	91,511	55.97	5,121,870.67
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	343.84	1,214,099.04
	NVIDIA CORP	205,210	137.76	28,269,729.60
	NXP SEMICONDUCTORS NV	21,751	154.72	3,365,314.72
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	63.83	2,200,092.44
	QORVO INC	8,556	84.90	726,404.40
	QUALCOMM	91,671	110.43	10,123,228.53
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	85.55	1,143,974.60
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,864	249.22	1,212,206.08
	TERADYNE INC	12,318	84.37	1,039,269.66
	TEXAS INSTRUMENTS	75,121	164.99	12,394,213.79
	アメリカドル 小計	27,834,437		2,648,480,627.97 (387,764,048,741)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	18.04	989,674.40
	CAMECO CORP	31,793	31.68	1,007,202.24
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,374	79.71	7,681,971.54
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	27.08	3,013,814.44
	ENBRIDGE	165,402	53.15	8,791,116.30
	IMPERIAL OIL	20,285	74.44	1,510,015.40
	KEYERA CORP	18,607	27.85	518,204.95
	PARKLAND CORP	14,075	24.75	348,356.25
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	44.68	2,040,356.88
	SUNCOR ENERGY	116,208	46.65	5,421,103.20
	TC ENERGY CORP	81,350	61.66	5,016,041.00
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	74.20	1,855,667.80
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	59.76	2,172,515.04
	BARRICK GOLD CORP	139,009	20.75	2,884,436.75
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	60.76	798,325.64
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	28.85	1,240,550.00
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	178.72	2,745,675.36
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	10.64	551,652.08
	KINROSS GOLD CORP	108,451	5.49	595,395.99

LUNDIN MINING CORP	62,243	7.59	472,424.37
NUTRIEN LTD	44,786	100.81	4,514,876.66
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	18.41	338,946.51
TECK RESOURCES LTD-CL B	40,179	44.24	1,777,518.96
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	105.53	643,733.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	48.28	1,653,010.64
CAE INC	25,999	24.05	625,275.95
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	100.20	760,017.00
WSP GLOBAL INC	9,951	164.28	1,634,750.28
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	34.18	461,600.90
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	68.86	705,470.70
THOMSON REUTERS CORP	13,293	143.77	1,911,134.61
AIR CANADA	13,805	18.23	251,665.15
CANADIAN NATL RAILWAY CO	48,612	161.27	7,839,657.24
CP RAILWAY LIMITED	75,991	101.83	7,738,163.53
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	130.10	759,393.70
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	74.89	1,743,588.98
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	88.25	270,927.50
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	36.28	619,626.12
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	81.86	1,888,755.78
QUEBECOR INC -CL B	15,200	26.73	406,296.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	35.80	1,268,107.60
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	149.70	675,596.10
DOLLARAMA INC	22,000	78.34	1,723,480.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	61.32	4,137,076.44
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	34.45	525,465.85
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	112.87	1,457,490.31
METRO INC	18,840	72.70	1,369,668.00
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	153.79	803,706.54
SAPUTO INC	20,898	32.80	685,454.40
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	8.87	184,496.00
BANK MONTREAL	55,487	126.73	7,031,867.51
BANK NOVA SCOTIA	99,336	66.01	6,557,169.36
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,829	61.69	4,431,131.01
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	94.96	2,591,363.44
ROYAL BANK OF CANADA	115,288	127.87	14,741,876.56
TORONTO-DOMINION BANK	148,462	87.60	13,005,271.20
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	116,005	54.86	6,364,034.30
IGM FINANCIAL INC	7,685	36.87	283,345.95
ONEX CORP	6,603	68.26	450,720.78
TMX GROUP LTD	4,685	132.05	618,654.25
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	710.80	1,516,136.40



	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	29.99	713,402.12
	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	69.84	705,314.16
	INTACT FINANCIAL CORP	15,012	195.51	2,934,996.12
	MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	22.23	3,440,714.94
	POWER CORP OF CANADA	43,577	31.95	1,392,285.15
	SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	59.00	2,696,418.00
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	161.95	435,645.50
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	6.28	247,432.00
	CGI INC - CL A	18,300	108.79	1,990,857.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	1,905.79	3,056,887.16
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	19.15	158,868.40
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	36.08	155,180.08
	OPEN TEXT CORP	20,463	37.32	763,679.16
	SHOPIFY INC - CLASS A	92,560	41.77	3,866,231.20
	BCE INC	6,203	61.31	380,305.93
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,196	57.75	1,743,819.00
	TELUS CORP	32,908	28.53	938,865.24
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	14.76	764,833.68
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	22.61	551,570.95
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	42.84	483,877.80
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.76	358,862.24
	EMERA INC	23,223	49.60	1,151,860.80
	FORTIS INC	40,183	52.61	2,114,027.63
	HYDRO ONE LTD	28,888	33.49	967,459.12
	NORTHLAND POWER INC	17,854	39.75	709,696.50
	カナダドル 小計	3,336,560		189,344,110.72 (20,487,032,779)
ユーロ	ENI	212,616	14.02	2,981,301.55
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	11.04	437,868.48
	NESTE OIL OYJ	36,735	46.04	1,691,279.40
	OMV AG	12,549	49.18	617,159.82
	REPSOL SA	111,112	13.94	1,548,901.28
	TENARIS SA	40,648	16.34	664,188.32
	TOTALENERGIES SE	203,322	56.71	11,530,390.62
	AIR LIQUIDE	43,239	134.56	5,818,239.84
	AKZO NOBEL	15,301	64.98	994,258.98
	ARCELORMITTAL	48,641	24.04	1,169,572.84
	ARKEMA	4,369	84.22	367,957.18
	BASF SE	73,837	47.54	3,510,580.16
	COVESTRO AG	14,454	35.36	511,093.44
	CRH PLC	65,449	36.18	2,368,272.06
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	18.50	296,684.50

HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	48.97	638,617.77
KONINKLIJKE DSM NV	13,707	120.25	1,648,266.75
OCI NV	12,000	37.10	445,200.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	33.79	659,040.16
SOLVAY SA	5,356	96.56	517,175.36
STORA ENSO OYJ R	42,169	14.13	596,058.81
SYMRISE AG	11,830	103.45	1,223,813.50
UMICORE	17,605	34.47	606,844.35
UPM KYMMENE OYJ	42,324	35.45	1,500,385.80
VOESTALPINE AG	7,152	24.40	174,508.80
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	22,552	26.03	587,028.56
AIRBUS SE	49,560	113.30	5,615,148.00
ALSTOM	24,388	22.85	557,265.80
BOUYGUES ORD	16,606	30.00	498,180.00
BRENTAG SE	12,514	65.68	821,919.52
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	14.37	1,164,748.75
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	28.00	934,864.00
DASSAULT AVIATION SA	2,130	144.60	307,998.00
EIFFAGE	5,924	91.44	541,690.56
FERROVIAL SA	43,631	23.82	1,039,290.42
FERROVIAL SA-RTS	43,631	0.41	18,071.96
GEA GROUP AG	13,382	38.24	511,727.68
IMCD NV	4,641	133.10	617,717.10
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	55.38	686,601.24
KION GROUP AG	5,887	25.49	150,059.63
KNORR-BREMSE AG	5,022	48.00	241,056.00
KONE OYJ-B	26,311	45.44	1,195,571.84
LEGRAND SA	21,768	75.70	1,647,837.60
MTU AERO ENGINES AG	3,962	180.60	715,537.20
PRYSMIAN SPA	21,155	32.46	686,691.30
RATIONAL AG	483	553.50	267,340.50
RHEINMETALL AG	3,660	160.05	585,783.00
SAFRAN SA	28,774	114.00	3,280,236.00
SAINT-GOBAIN	40,093	42.38	1,699,141.34
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,670	134.56	6,010,795.20
SIEMENS	63,788	115.76	7,384,098.88
SIEMENS ENERGY AG	36,841	12.94	476,906.74
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	18.01	404,166.52
THALES SA	8,524	125.20	1,067,204.80
VINCI S.A.	44,993	94.43	4,248,688.99
WARTSILA OYJ	41,917	7.49	314,125.99
BUREAU VERITAS SA	25,073	25.97	651,145.81

RANDSTAD NV	10,558	52.80	557,462.40
TELEPERFORMANCE	4,734	266.20	1,260,190.80
WOLTERS KLUWER	20,839	101.10	2,106,822.90
ADP	2,382	138.60	330,145.20
AENA SME SA	5,508	119.60	658,756.80
ATLANTIA SPA	43,726	22.63	989,519.38
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	7.19	326,152.19
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	35.77	2,815,993.35
GETLINK	35,220	16.25	572,501.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	80.25	2,095,086.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	76.40	381,312.40
CONTINENTAL AG	8,168	55.54	453,650.72
DR ING HC F PORSCHE AG	9,400	101.45	953,630.00
FERRARI NV	10,170	203.00	2,064,510.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	64,434	59.92	3,860,885.28
MICHELIN	55,356	26.19	1,449,773.64
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	57.18	671,579.10
RENAULT SA	17,362	29.40	510,529.61
STELLANTIS NV	175,794	13.70	2,409,432.56
VALEO SA	16,596	17.11	284,040.54
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,874	135.26	2,147,117.24
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	179.75	446,858.50
ADIDAS AG	13,972	124.44	1,738,675.68
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,354.50	3,439,075.50
KERING	6,271	512.20	3,212,006.20
LVMH	22,668	658.00	14,915,544.00
MONCLER SPA	19,057	46.72	890,343.04
PUMA SE	9,220	45.83	422,552.60
SEB SA	2,282	69.55	158,713.10
ACCOR	14,436	24.21	349,495.56
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	130.40	1,701,459.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	34.69	281,266.52
SODEXO	6,027	88.92	535,920.84
BOLLORE SE	83,646	5.14	429,940.44
PUBLICIS GROUPE	17,077	61.20	1,045,112.40
SCOUT24 SE	7,492	53.00	397,076.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	25.88	182,997.48
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	20.15	1,234,046.45
VIVENDI SE	61,243	8.33	510,644.13
D' IETEREN GROUP	2,217	167.10	370,460.70
DELIVERY HERO SE	13,414	34.82	467,075.48
INDITEX	87,326	24.32	2,123,768.32

JUST EAT TAKEAWAY	15,572	20.62	321,172.50
PROSUS	66,706	48.70	3,248,582.20
ZALANDO SE	17,664	25.89	457,320.96
CARREFOUR	52,544	16.51	867,764.16
HELLOFRESH SE	13,805	22.50	310,612.50
JERONIMO MARTINS	24,901	21.06	524,415.06
KESKO OYJ-B SHS	20,083	21.18	425,357.94
KONINKLIJKE AHOLD NV	86,170	29.15	2,512,286.35
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,659	52.19	3,792,073.21
DANONE (GROUPE)	51,543	49.93	2,573,799.70
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	9.27	455,238.25
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	69.00	638,319.00
HEINEKEN NV	20,157	84.66	1,706,491.62
JDE PEET'S BV	7,000	28.90	202,300.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	89.14	1,163,277.00
PERNOD-RICARD	16,694	180.50	3,013,267.00
REMY COINTREAU	1,382	158.90	219,599.80
BEIERSDORF AG	7,430	98.24	729,923.20
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	61.00	535,580.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	64.74	934,780.86
LOREAL	19,843	327.80	6,504,535.40
AMPLIFON SPA	11,650	26.56	309,424.00
BIOMERIEUX	3,044	95.52	290,762.88
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	121.10	415,373.00
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	133.15	275,620.50
ESSILORLUXOTTICA	22,910	165.75	3,797,332.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	28.17	478,467.45
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	23.35	786,638.15
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	12.84	921,908.24
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	48.83	1,053,116.61
ARGENX SE	4,713	369.40	1,740,982.20
BAYER	78,757	50.26	3,958,326.82
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	66.90	683,718.00
GRIFOLS SA	27,685	9.58	265,443.78
IPSEN	3,532	105.40	372,272.80
MERCK KGAA	10,555	171.20	1,807,016.00
ORION OYJ-CLASS B	9,854	48.61	479,002.94
QIAGEN N.V.	17,038	44.22	753,420.36
RECORDATI SPA	9,859	40.58	400,078.22
SANOFI	93,369	86.84	8,108,163.96
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	370.90	676,521.60
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,539	326.70	829,491.30

UCB (GROUPE)	9,389	77.30	725,769.70
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	11.11	443,721.91
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	5.28	2,827,836.54
BANCO SANTANDER SA	1,393,640	2.61	3,640,884.50
BNP PARIBAS	92,730	50.26	4,660,609.80
CAIXABANK	330,447	3.27	1,080,892.13
COMMERZBANK AG	81,889	7.65	626,778.40
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	9.70	964,992.45
ERSTE GROUP BANK AG	31,905	28.23	900,678.15
FINECOBANK SPA	53,120	14.29	759,084.80
ING GROEP NV-CVA	324,888	10.98	3,569,219.56
INTESA SANPAOLO	1,322,943	2.15	2,849,619.22
KBC GROEP NV	18,608	50.28	935,610.24
MEDIOBANCA	53,990	9.74	526,078.56
SOCIETE GENERALE	63,329	23.40	1,481,898.60
UNICREDIT SPA	168,352	12.85	2,164,670.01
AMUNDI SA	4,626	51.55	238,470.30
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	9.69	1,556,821.80
DEUTSCHE BOERSE	14,999	162.70	2,440,337.30
EURAZEO SA	3,357	58.55	196,552.35
EURONEXT NV	6,480	65.78	426,254.40
EXOR NV	7,825	69.86	546,654.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	76.24	649,183.60
SOFINA	1,238	214.20	265,179.60
WENDEL	2,023	83.45	168,819.35
AEGON	148,741	4.74	706,073.52
AGEAS	11,086	36.15	400,758.90
ALLIANZ SE-REG	34,133	188.92	6,448,406.36
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	16.32	1,398,024.02
AXA SA	154,335	26.50	4,089,877.50
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	170.40	738,343.20
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,889	282.30	3,356,264.70
NN GROUP NV	22,611	43.27	978,377.97
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.35	430,427.25
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	47.35	1,830,314.25
AROUNDTOWN SA	64,068	2.18	139,668.24
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	68.24	359,966.00
VONOVIA SE	59,080	23.29	1,375,973.20
ADYEN NV	1,746	1,333.20	2,327,767.20
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	50.98	1,814,072.32
BECHTLE AG	7,659	36.75	281,468.25
CAPGEMINI SA	13,877	165.50	2,296,643.50

DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	33.82	1,784,579.94
EDENRED	22,564	54.04	1,219,358.56
NEMETSCHKE SE	5,455	45.53	248,366.15
NEXI SPA	48,458	8.91	432,051.52
SAP SE	85,927	98.16	8,434,594.32
WORLDLINE SA	20,332	43.75	889,525.00
NOKIA OYJ	427,600	4.45	1,903,675.20
CELLNEX TELECOM SA	46,824	34.24	1,603,253.76
DEUTSCHE TELEKOM	271,698	19.71	5,355,167.58
ELISA A	10,227	49.43	505,520.61
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.50	288,805.50
KPN (KON.)	282,927	2.81	796,439.50
ORANGE	153,815	9.75	1,499,850.06
PROXIMUS	13,141	10.84	142,514.14
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.23	198,900.38
TELEFONICA	431,420	3.61	1,557,857.62
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.36	233,658.40
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	19.56	186,121.84
ACCIONA SA	2,181	182.80	398,686.80
E.ON SE	195,549	8.69	1,699,711.90
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	21.60	463,665.60
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.90	470,299.90
ELIA GROUP SA/NV	3,125	130.60	408,125.00
ENAGAS	21,663	16.83	364,588.29
ENDESA	25,972	17.72	460,223.84
ENEL	650,125	4.81	3,132,952.37
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.42	997,828.26
ENGIE	158,924	13.37	2,125,131.72
FORTUM OYJ	32,550	14.75	480,275.25
IBERDROLA SA	477,647	10.26	4,903,046.45
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	25.82	258,458.20
RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	16.81	515,697.18
RWE STAMM	55,432	39.44	2,186,238.08
SNAM SPA	147,559	4.73	698,101.62
TERNA SPA	102,810	7.09	729,334.14
UNIPER SE	7,335	3.12	22,914.54
VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	24.03	1,226,178.81
VERBUND AG	6,430	81.20	522,116.00
ASM INTERNATIONAL NV	3,995	235.90	942,420.50
ASML HOLDING NV	33,358	495.90	16,542,232.20
INFINEON TECHNOLOGIES	110,035	27.73	3,051,270.55
STMICROELECTRONICS	55,076	33.18	1,827,421.68

	ユーロ 小計	15,009,866		344,064,403.93 (50,460,485,480)
イギリスポンド	BP PLC	1,596,790	4.82	7,698,124.59
	SHELL PLC-NEW	608,239	23.83	14,497,376.56
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	30.57	3,123,419.70
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	12.99	465,769.44
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	66.50	726,446.00
	GLENCORE PLC	817,868	5.10	4,174,398.27
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	20.46	344,710.08
	MONDI PLC	36,710	15.50	569,005.00
	RIO TINTO PLC REG	94,110	51.19	4,817,490.90
	ASHTED GROUP PLC	37,687	48.32	1,821,035.84
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	8.00	2,082,392.62
	BUNZL PLC	24,880	29.37	730,725.60
	DCC PLC	6,622	45.53	301,499.66
	FERGUSON PLC	17,761	97.62	1,733,828.82
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.21	388,848.83
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.88	563,542.55
	SMITHS GROUP PLC	26,476	16.06	425,336.94
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	112.80	621,979.20
	EXPERIAN PLC	74,115	27.68	2,051,503.20
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	38.76	538,376.40
	RELX PLC	154,242	23.24	3,584,584.08
	RENTOKIL INITIAL PLC	212,480	5.41	1,149,516.80
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	3.89	285,121.79
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	36.21	278,382.48
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	19.72	587,182.72
	PERSIMMON PLC	25,686	12.81	329,166.09
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	0.97	258,769.09
	COMPASS GROUP PLC	142,427	18.60	2,649,142.20
	ENTAIN PLC	49,630	13.04	647,423.35
	INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	47.08	697,301.88
	WHITBREAD PLC	17,434	25.35	441,951.90
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.54	401,439.48	
INFORMA PLC	110,598	5.50	608,952.58	
PEARSON	55,305	9.38	519,092.73	
WPP PLC	95,821	8.17	783,432.49	
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.07	222,233.46	
KINGFISHER PLC	153,717	2.26	347,707.85	
NEXT PLC	11,468	54.20	621,565.60	
OCADO GROUP PLC	54,753	6.68	365,969.05	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.18	323,963.64	

TESCO PLC	601,050	2.28	1,372,197.15	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	15.09	388,416.60	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	178,799	33.92	6,065,756.07	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	20.00	359,200.00	
DIAGEO	189,615	36.24	6,872,595.67	
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	21.53	1,638,002.40	
HALEON PLC	405,046	2.86	1,159,444.17	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,052	56.82	3,412,154.64	
UNILEVER PLC	209,465	40.70	8,525,225.50	
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.30	706,528.50	
ASTRAZENECA	126,291	108.46	13,697,521.86	
GSK PLC	334,172	14.07	4,702,468.38	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	13.28	218,591.39	
BARCLAYS	1,339,545	1.54	2,068,257.48	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,655,458	4.76	7,891,568.28	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,667,831	0.42	2,412,512.26	
NATWEST GROUP PLC	412,008	2.37	976,458.96	
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.63	1,196,920.76	
3I GROUP PLC	74,757	12.53	936,705.21	
ABRDN PLC	153,430	1.79	275,560.28	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.28	274,158.75	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	78.88	2,074,307.36	
M&G PLC	229,107	1.77	407,466.79	
SCHRODERS PLC	69,376	4.17	289,506.04	
ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	10.73	439,426.49	
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	19.86	322,905.57	
AVIVA PLC	225,378	4.26	960,786.41	
LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.36	1,088,773.51	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.51	281,219.51	
PRUDENTIAL	230,270	9.02	2,077,956.48	
AVEVA GROUP PLC	10,917	31.30	341,702.10	
SAGE GROUP PLC	76,660	7.35	563,451.00	
HALMA PLC	31,069	22.13	687,556.97	
BT GROUP PLC	557,358	1.15	645,699.24	
VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.04	2,295,140.58	
NATIONAL GRID PLC	302,035	9.86	2,979,877.31	
SEVERN TRENT PLC	22,468	26.38	592,705.84	
SSE PLC	90,604	16.14	1,462,348.56	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	9.87	578,301.76	
イギリスポンド 小計	23,204,687		146,018,085.29 (24,307,630,658)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	16.26	282,891.48



EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	648.50	372,239.00
GIVAUDAN-REG	748	3,008.00	2,249,984.00
HOLCIM LTD	44,847	47.37	2,124,402.39
SIG GROUP AG	26,203	20.60	539,781.80
SIKA AG-BR	11,714	235.80	2,762,161.20
ABB LTD	137,175	28.74	3,942,409.50
GEBERIT AG-REG	2,964	441.50	1,308,606.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	165.60	339,148.80
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	171.15	529,195.80
VAT GROUP AG	1,956	245.00	479,220.00
ADECCO GROUP AG-REG	10,450	32.76	342,342.00
SGS SA	506	2,248.00	1,137,488.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	220.20	1,007,855.40
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,318	103.75	4,494,242.50
SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	240.40	596,913.20
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	44.86	176,658.68
BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,929.00	540,120.00
CHOCOLAFABRIKEN LINDT-REG	8	97,900.00	783,200.00
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,800.00	803,600.00
NESTLE SA - REGISTERED	230,976	109.12	25,204,101.12
ALCON INC	42,458	57.50	2,441,335.00
SONOVA HOLDING AG-REG	4,686	234.30	1,097,929.80
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	99.78	852,121.20
BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	77.25	142,912.50
LONZA GROUP AG-REG	6,283	493.20	3,098,775.60
NOVARTIS	177,027	81.81	14,482,578.87
ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	398.40	882,456.00
ROCHE HOLDING GENUSS	57,316	327.80	18,788,184.80
CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	4.00	854,652.05
JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	51.12	966,014.64
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	908.40	1,665,097.20
UBS GROUP AG	281,888	16.35	4,608,868.80
BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	139.10	441,503.40
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	493.40	1,193,534.60
SWISS RE LTD	24,445	76.40	1,867,598.00
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,554	436.20	5,476,054.80
SWISS PRIME SITE-REG	5,679	81.00	459,999.00
TEMENOS AG - REG	5,150	60.00	309,000.00
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	53.64	787,757.04
SWISSCOM	2,187	499.00	1,091,313.00
スイスフラン 小計	1,431,967		111,524,247.17 (16,593,692,736)

スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	354.75	7,893,897.00
	HOLMEN AB-B SHARES	10,000	407.60	4,076,000.00
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	138.90	6,095,904.30
	ALFA LAVAL AB	27,268	288.70	7,872,271.60
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	228.00	17,820,024.00
	ATLAS COPCO A	227,097	125.04	28,396,208.88
	ATLAS COPCO B	127,608	112.32	14,332,930.56
	EPIROC AB-A	53,479	183.05	9,789,330.95
	EPIROC AB-B	28,804	158.55	4,566,874.20
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	73.40	2,841,460.80
	INDUTRADE AB	22,644	203.90	4,617,111.60
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	205.50	2,877,411.00
	LIFCO AB-B SHS	17,970	169.10	3,038,727.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	91.78	11,274,989.44
	SANDVIK AB	87,644	187.05	16,393,810.20
	SKANSKA B	25,507	176.60	4,504,536.20
	SKF AB-B	37,718	175.70	6,627,052.60
	VOLVO AB-A SHS	13,514	199.00	2,689,286.00
	VOLVO B	121,238	188.54	22,858,212.52
	SECURITAS B	29,533	90.50	2,672,736.50
	VOLVO CAR AB-B	49,839	50.08	2,495,937.12
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	141.60	3,011,690.40
	EVOLUTION AB	14,096	1,001.60	14,118,553.60
	EMBRACER GROUP AB	53,147	52.64	2,797,658.08
	HENNES & MAURITZ B	55,229	118.26	6,531,381.54
	SWEDISH MATCH AB	127,270	116.00	14,763,320.00
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	238.10	11,779,759.40
	GETINGE AB-B SHS	17,796	233.40	4,153,586.40
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	204.10	2,925,773.50
	NORDEA BANK ABP	279,221	106.26	29,670,023.46
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	117.70	15,447,536.50
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	103.80	11,494,396.80
	SWEDBANK AB-A	72,526	164.00	11,894,264.00
	EQT AB	23,207	218.90	5,080,012.30
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	255.70	3,021,862.60	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	254.60	2,843,372.80	
INVESTOR AB-A SHS	38,925	191.70	7,461,922.50	
INVESTOR AB-B SHS	156,321	184.16	28,788,075.36	
KINNEVIK AB - B	18,792	147.00	2,762,424.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	449.80	3,274,544.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	43.85	2,486,578.50	
SAGAX AB-B	12,402	213.50	2,647,827.00	

	ERICSSON (LM) B	255,508	60.26	15,396,912.08
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	112.35	17,283,699.30
	TELE2 AB-B SHS	46,762	91.46	4,276,852.52
	TELIA CO AB	230,643	29.34	6,767,065.62
	スウェーデンクローナ 小計	3,169,430		414,413,804.73 (5,582,153,949)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	27,755	354.00	9,825,270.00
	EQUINOR ASA	81,436	374.85	30,526,284.60
	NORSK HYDRO	96,800	68.94	6,673,392.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	469.30	5,865,311.40
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	382.20	3,304,119.00
	ADEVINTA ASA	19,117	73.90	1,412,746.30
	MOWI ASA	31,968	155.25	4,963,032.00
	ORKLA	69,804	67.74	4,728,522.96
	SALMAR ASA	5,423	335.00	1,816,705.00
	DNB BANK ASA	71,795	182.15	13,077,459.25
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	192.90	3,582,924.60
	TELENOR ASA	51,193	95.60	4,894,050.80
	ノルウェークローネ 小計	495,008		90,669,817.91 (1,278,444,432)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	426.50	3,617,999.50
	NOVOZYMES A/S	17,111	393.20	6,728,045.20
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,541.00	1,163,455.00
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	81,654	167.50	13,677,045.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	14,710.00	3,221,490.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	15,150.00	6,575,100.00
	DSV A/S	15,307	1,050.00	16,072,350.00
	PANDORA A/S	8,163	473.00	3,861,099.00
	CARLSBERG AS-B	8,481	902.80	7,656,646.80
	COLOPLAST-B	9,208	847.00	7,799,176.00
	DEMANT A/S	8,512	190.75	1,623,664.00
	GN STORE NORD A/S	9,226	173.20	1,597,943.20
	GENMAB A/S	5,250	2,981.00	15,650,250.00
	NOVO NORDISK A/S-B	135,410	848.80	114,936,008.00
	DANSKE BANK A/S	56,132	122.70	6,887,396.40
TRYG A/S	29,772	165.80	4,936,197.60	
	ORSTED A/S	15,439	642.50	9,919,557.50
	デンマーククローネ 小計	409,556		225,923,423.20 (4,455,209,905)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	27.83	574,105.07
	SANTOS	265,406	7.64	2,027,701.84
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	28.53	365,554.89
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	158,086	38.89	6,147,964.54

BHP GROUP LTD	414,748	41.18	17,079,322.64
BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	16.30	566,751.00
EVOLUTION MINING LTD	122,154	2.35	287,061.90
FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	17.12	2,372,695.04
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	28.49	1,052,648.52
MINERAL RESOURCES LTD	14,409	82.70	1,191,624.30
NEWCREST MINING LIMITED	73,939	19.41	1,435,155.99
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	10.04	1,020,345.12
ORICA LTD	38,288	15.07	577,000.16
RIO TINTO LTD	28,818	98.63	2,842,319.34
SOUTH32 LTD	407,531	3.92	1,597,521.52
REECE LTD	16,814	14.85	249,687.90
BRAMBLES LTD	108,007	11.57	1,249,640.99
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.70	442,486.70
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.01	510,850.00
TRANSURBAN GROUP	249,674	13.63	3,403,056.62
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	37.01	1,710,232.10
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	57.26	202,757.66
IDP EDUCATION LTD	17,793	28.58	508,523.94
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.54	826,339.02
REA GROUP LTD	3,586	114.11	409,198.46
SEEK LTD	28,001	20.81	582,700.81
WESFARMERS LTD	91,917	46.24	4,250,242.08
COLES GROUP LTD	108,486	16.48	1,787,849.28
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.99	768,207.99
WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	33.20	3,316,713.20
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	12.72	813,571.20
COCHLEAR LIMITED	4,783	199.63	954,830.29
RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	58.70	953,757.60
SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	32.27	1,202,089.77
CSL LIMITED	39,814	279.61	11,132,392.54
AUST AND NZ BANKING GROUP	247,511	24.55	6,076,395.05
COMMONWEALTH BANK OF AUST	139,969	104.77	14,664,552.13
NATIONAL AUSTRALIA BANK	267,570	31.66	8,471,266.20
WESTPAC BANKING	283,793	23.72	6,731,569.96
ASX LTD	14,549	69.50	1,011,155.50
MACQUARIE GROUP LIMITED	29,434	171.45	5,046,459.30
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	236,496	4.97	1,175,385.12
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	2.77	643,146.91
QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.92	1,441,755.72
SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	11.93	1,131,727.52
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	26.00	1,153,776.00

	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	53.57	739,319.57
	XERO LTD	11,340	72.62	823,510.80
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.93	1,212,275.31
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	5.81	880,023.27
	オーストラリアドル 小計	5,488,661		125,615,218.38 (11,824,160,506)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.49	882,853.79
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	19.52	780,409.60
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.15	891,557.70
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.48	354,079.24
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.54	501,869.76
	ニュージーランドドル 小計	506,126		3,410,770.09 (293,940,166)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	41.60	8,902,233.60
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	82.75	8,854,250.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	12.66	2,177,520.00
	MTR CORP	125,000	35.80	4,475,000.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	14.18	1,701,600.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	43.00	7,482,000.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	17.16	3,397,680.00
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	15.54	2,675,988.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	18.68	2,725,412.00
	WH GROUP LTD	658,301	4.26	2,804,362.26
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	25.60	7,206,400.00
	HANG SENG BANK	59,400	114.10	6,777,540.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	260.00	24,908,000.00
	AIA GROUP LTD	982,200	68.05	66,838,710.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	45.10	7,418,769.60
	ESR GROUP LTD	157,000	15.02	2,358,140.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	11.12	1,923,760.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	21.65	2,711,186.20
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	16.60	2,263,825.00
	SINO LAND CO	315,400	9.01	2,841,754.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	122,500	84.85	10,394,125.00
	SWIRE PACIFIC A	40,500	56.05	2,270,025.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	16.14	1,552,668.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	33.55	3,992,450.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	38.00	2,565,000.00
	CLP HOLDINGS	137,500	54.85	7,541,875.00
HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.34	5,735,525.38	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	37.80	4,233,600.00	
	6,176,653		208,729,399.04	

香港ドル 小計				(3,892,803,292)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,800	7.08	798,624.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.36	495,264.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.32	576,326.24
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.81	498,150.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.95	705,470.00
	DBS GROUP	150,000	34.67	5,200,500.00
	OCBC BANK	282,100	12.25	3,455,725.00
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	29.14	2,736,246.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	8.61	568,260.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.35	748,725.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.81	334,268.00
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.42	304,950.00
	VENTURE CORP LTD	25,700	17.21	442,297.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.55	1,736,404.65
シンガポールドル 小計		2,774,575		18,601,209.89 (1,943,082,385)
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	29.59	1,758,444.93
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	693.00	1,487,178.00
	BANK HAPOLIM BM	98,310	34.30	3,372,033.00
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	134,557	34.34	4,620,687.38
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	20.70	2,059,650.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	132.30	1,654,146.90
	AZRIELI GROUP	4,323	253.00	1,093,719.00
	NICE LTD	4,991	597.10	2,980,126.10
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	176,957	6.30	1,114,829.10
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	142.10	1,421,000.00
イスラエルシェケル 小計		602,714		21,561,814.41 (888,092,324)
合 計		90,440,240		529,770,777,353 (529,770,777,353)

## (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	49,777.00	
		アメリカドル 小計	38,290	49,777.00 (7,287,850)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	109,658	1,174,437.18	
		LENDLEASE GROUP	64,786	518,935.86	
			174,444	1,693,373.04	

		オーストラリアドル 小計		(159,397,204)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,190,700.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,787,750.00	
		香港ドル 小計	535,500	3,978,450.00	
				(74,198,092)	
		投資信託受益証券合計	748,234	240,883,146	
				(240,883,146)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,110	1,728,581.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	745,224.16	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,131	7,464,816.24	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	715,126.24	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	1,801,561.36	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	796,574.25	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	847,508.13	
		CROWN CASTLE INC	35,305	4,506,683.25	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,274,915.79	
		EQUINIX INC	7,423	4,438,582.85	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	870,621.10	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,592	1,766,050.56	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,079,204.70	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,647,914.84	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	21,791	1,090,639.55	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	584,288.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,081,833.50	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	953,786.40	
		INVITATION HOMES INC	51,127	1,524,095.87	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,146,939.42	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	994,820.69	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	562,404.64	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,400,030.70	
		PROLOGIS INC	74,847	8,142,605.13	
		PUBLIC STORAGE	12,922	3,679,022.62	
		REALTY INCOME CORP	49,865	3,153,961.25	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	778,309.31	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,358,007.59	
		SIMON PROPERTY GROUP	27,091	3,059,115.72	
		SUN COMMUNITIES INC	10,227	1,364,486.34	
		UDR INC	24,265	911,393.40	
		VENTAS INC	31,565	1,317,838.75	
		VICI PROPERTIES INC	80,143	2,526,908.79	
		VORNADO REALTY TRUST	11,390	256,275.00	
		WELLTOWER INC	37,724	2,508,646.00	

	WP CAREY INC	16,024	1,256,922.56	
	アメリカドル 小計	1,000,838	71,335,696.10 (10,444,259,266)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	201,295.53	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	315,531.30	
	カナダドル 小計	20,377	516,826.83 (55,920,663)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	279,608.70	
	GECINA SA	3,139	290,357.50	
	KLEPIERRE	17,225	354,662.75	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	506,440.20	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	343,770.68	
	ユーロ 小計	48,695	1,774,839.83 (260,298,009)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	303,361.48	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	276,808.22	
	SEGRE PLC	93,383	738,659.53	
	イギリスポンド 小計	219,086	1,318,829.23 (219,545,501)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	731,079.30	
	GOODMAN GROUP	133,807	2,292,113.91	
	GPT GROUP	167,884	721,901.20	
	MIRVAC GROUP	266,683	560,034.30	
	SCENTRE GROUP	382,183	1,108,330.70	
	STOCKLAND	207,412	740,460.84	
	VICINITY CENTERS	365,149	710,214.80	
	オーストラリアドル 小計	1,617,208	6,864,135.05 (646,121,032)	
香港ドル	LINK REIT	170,500	8,490,900.00	
	香港ドル 小計	170,500	8,490,900.00 (158,355,285)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	735,917.42	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	460,429	874,815.10	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	424,783.50	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	347,600.00	
	シンガポールドル 小計	1,247,756	2,383,116.02 (248,940,299)	
	投資証券合計	4,324,460	12,033,440,055 (12,033,440,055)	
	合計		12,274,323,201 (12,274,323,201)	

(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 598銘柄	97.4%			71.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 36銘柄			2.6%	1.9%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%			3.8%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 225銘柄	99.5%			9.3%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79銘柄	99.1%			4.5%
	投資証券 3銘柄			0.9%	0.0%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%			3.1%
スウェーデンクローナ	株式 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	93.6%			2.2%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.3%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.1%	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	94.4%			0.7%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.8%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	88.6%			0.4%
	投資証券 4銘柄			11.4%	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。

## 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11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,635,569,026
コール・ローン	45,909,594
株式	109,447,934,805
投資信託受益証券	311,049,635
投資証券	119,915,536
派生商品評価勘定	69,652,361
未収配当金	87,511,767
前払金	27,880,045
差入委託証拠金	662,637,972
流動資産合計	114,408,060,741
資産合計	114,408,060,741
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	97,249,844
未払金	997,804
未払解約金	66,150,211
未払利息	103
流動負債合計	164,397,962
負債合計	164,397,962
純資産の部	
元本等	
元本	32,714,193,593
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	81,529,469,186
元本等合計	114,243,662,779
純資産合計	114,243,662,779
負債純資産合計	114,408,060,741

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p>

	2022年11月10日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2022年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		32,714,193,593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)	3.4922円 (34,922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11月10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11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	2022年11月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月11日
期首元本額	30,068,082,545円
期中追加設定元本額	3,046,697,313円
期中一部解約元本額	400,586,265円
期末元本額	32,714,193,593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	7,978,580,179円
世界経済インデックスファンド	6,589,986,448円
D C 新興国株式インデックス・オープン	5,600,342,742円
D C 世界経済インデックスファンド	5,680,415,082円

区分	2022年11月10日現在
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	139,005,247円
分散投資コア戦略ファンドA	276,729,621円
分散投資コア戦略ファンドS	1,486,419,585円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	843,125,020円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	644,208,201円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	342,799,742円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	16,519,599円
SMT インデックスバランス・オープン	83,546,687円
SMT 世界経済インデックス・オープン	183,702,601円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	733,885,015円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	122,718,011円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,055,170円
グローバル経済コア	359,260,790円
My SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	70,401,101円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	33,287,031円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	29,304,606円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	11,401,051円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	13,934,867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)	1,196,037,403円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	196,448,069円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	66,972,461円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	10,103,131円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	29,537,683,121
投資信託受益証券	27,640,667
投資証券	3,497,862
合計	29,506,544,592

(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11月10日現在)

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		
			時価 (円)	評価損益 (円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,365,044,314	-	4,337,565,353	27,478,961
合計		4,365,044,314	-	4,337,565,353	27,478,961

## (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11月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		
			時価 (円)	評価損益 (円)	
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	27,686,800	-	27,805,322	118,522
	アメリカドル	27,686,800	-	27,805,322	118,522
合計		27,686,800	-	27,805,322	118,522

## (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	1.54	215,373.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	7.58	128,329.40	
	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	53.34	617,197.14	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	53,727	18.68	1,003,620.36	

	LI AUTO INC - ADR	67,571	16.18	1,093,298.78	
	NIO INC - ADR	171,200	9.25	1,583,600.00	
	XPENG INC - ADR	53,231	6.67	355,050.77	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	24,287	31.78	771,840.86	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	4.81	197,488.98	
	TRIP.COM GROUP LTD	67,056	25.00	1,676,400.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	54,093	49.87	2,697,617.91	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	28.81	353,873.23	
	IQIYI INC-ADR	28,984	2.02	58,547.68	
	JOYY INC	6,185	25.36	156,851.60	
	KANZHUN LTD	22,125	11.95	264,393.75	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	3.66	415,582.02	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	12.25	64,300.25	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	-	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-	
	PINDUODUO INC-ADR	65,522	59.16	3,876,281.52	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	7.66	404,179.90	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	-	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	68,136	1.34	91,302.24	
	BEIGENE LTD-ADR	6,085	176.23	1,072,359.55	
	HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	9.05	65,549.15	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	6,299	51.50	324,398.50	
	ZAI LAB LTD-ADR	12,825	28.57	366,410.25	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	403,900	1.31	529,109.00	
	CREDICORP LTD	8,778	152.00	1,334,256.00	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-	
	360 DIGITECH INC	8,061	12.38	99,795.18	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	1.57	179,188.81	
	KE HOLDINGS INC	80,573	10.41	838,764.93	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.78	119,506.68	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	24,700	3.13	77,360.40	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	51.72	405,226.20	
	アメリカドル 小計	2,020,393		21,437,054.04 (3,138,599,081)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,063,461	7.94	16,383,880.34	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	422,992	75.01	31,728,629.92	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	258.10	3,742,450.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	37.30	6,659,989.60	
	ALFA S.A.B. -A	313,500	13.55	4,247,925.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	82.15	3,080,625.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	450.22	10,492,377.10	



	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	312.69	13,658,299.20	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	161.61	6,898,322.85	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	288,490	20.19	5,824,613.10	
	WALMART DE MEXICO-SER V	666,680	73.98	49,320,986.40	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	168.58	8,509,075.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	242,440	146.76	35,580,494.40	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	227.46	5,904,861.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	81.41	14,800,338.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	31.67	5,757,606.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	324,600	152.94	49,644,324.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	36.63	9,249,075.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,513,640	19.78	69,499,799.20	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	22.57	4,990,227.00	
	SITIOS LATINOAMERICA SAB DE	175,682	7.25	1,273,694.50	
	メキシコペソ 小計	9,265,342		357,247,593.71 (2,674,677,009)	
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	17.94	2,908,074.00	
	PETRO RIO SA	84,700	37.22	3,152,534.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	496,300	30.06	14,918,778.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	576,440	26.90	15,506,236.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	13.56	1,025,136.00	
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	29.88	576,684.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	13.38	1,329,972.00	
	GERDAU SA-PREF	141,800	28.51	4,042,718.00	
	SUZANO SA	90,079	55.12	4,965,154.48	
	VALE SA	509,587	73.15	37,276,289.05	
	WEG SA	217,544	40.60	8,832,286.40	
	CCR SA	125,600	12.25	1,538,600.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	92,452	70.24	6,493,828.48	
	LOCALIZA RENT A CAR SA-RIGHT	283	13.06	3,695.98	
	RUMO SA	159,700	20.49	3,272,253.00	
	AMERICANAS SA	73,040	13.89	1,014,525.60	
	LOJAS RENNER S.A.	115,947	27.43	3,180,426.21	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	4.47	1,365,585.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	18.41	3,184,930.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	18.29	759,035.00	
	RAIA DROGASIL SA	122,500	25.77	3,156,825.00	
	AMBEV SA	628,600	16.48	10,359,328.00	
	BRF SA	106,300	11.98	1,273,474.00	
	JBS SA	110,000	25.33	2,786,300.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	13.14	1,318,047.12	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	613,154	7.39	4,531,208.06	

	REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,600	32.30	1,472,880.00	
	HYPERA SA	54,500	48.57	2,647,065.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	13.27	4,326,325.21	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	584,982	15.35	8,979,473.70	
	BANCO DO BRASIL S.A.	116,000	37.06	4,298,960.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	612,281	28.15	17,235,710.15	
	ITAUSA SA	528,325	10.17	5,373,065.25	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	799,809	15.24	12,189,089.16	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	31.25	2,156,250.00	
	TOTVS SA	57,900	33.39	1,933,281.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	41.05	2,146,915.00	
	TIM SA	96,100	13.70	1,316,570.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	52.35	1,936,950.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	122,400	48.40	5,924,160.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	11.36	2,406,354.72	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	57.68	2,912,840.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	35.01	952,272.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	40.41	1,868,962.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	29.35	4,845,685.00	
	ブラジルリアル 小計	9,243,831		223,694,732.07 (6,296,581,687)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,850.00	306,400,500.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,610.00	218,903,650.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	18,037	94,601.00	1,706,318,237.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	70.50	173,513,754.00	
	FALABELLA SA	70,837	1,789.90	126,791,146.30	
	CENCOSUD SA	137,988	1,340.00	184,903,920.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	5,160.10	38,107,338.50	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	86.00	418,187,040.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,193	26,198.00	162,244,214.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	33.89	391,435,227.41	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	95.98	335,096,413.70	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	34.30	87,851,835.40	
	チリペソ 小計	25,347,725		4,149,753,276.31 (669,591,739)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	793,400	2,401.00	1,904,953,400.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	39,000.00	1,145,664,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	31,900.00	1,963,923,500.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	18,780.00	948,596,580.00	
	コロンビアペソ 小計	934,852		5,963,137,480.00 (178,160,658)	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	9,898	17.01	168,364.98	

	OPAP SA	18,496	12.68	234,529.28	
	JUMBO SA	19,341	15.22	294,370.02	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	0.98	259,238.37	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.07	458,024.93	
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	3.82	281,599.36	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	15.95	418,001.65	
	PUBLIC POWER CORP	20,834	6.40	133,337.60	
	ユーロ 小計	859,745		2,247,466.19	(329,613,391)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	430.80	4,998,572.40	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	34.72	4,053,733.60	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	37.74	3,757,620.84	
	KOC HOLDING AS	89,884	62.35	5,604,267.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	34.26	10,235,106.48	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	111.20	9,631,588.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	364.40	2,368,964.40	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	140.80	6,029,619.20	
	AKBANK T.A.S.	276,321	14.89	4,114,419.69	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	35.72	7,550,207.84	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	9.06	3,483,234.78	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	32.14	4,598,944.74	
	トルコリラ 小計	1,767,743		66,426,279.37	(523,146,805)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	22,644	753.50	17,062,254.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	73.30	4,450,043.00	
	CEZ AS	17,997	838.00	15,081,486.00	
	チェココルナ 小計	101,351		36,593,783.00	(220,686,127)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,652.00	118,074,996.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	8,445.00	128,178,210.00	
	OTP BANK NYRT	38,695	9,982.00	386,253,490.00	
	ハンガリーフォリント 小計	98,396		632,506,696.00	(230,866,841)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	83,330	61.00	5,083,130.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	114.60	2,313,315.60	
	LPP SA	124	8,765.00	1,086,860.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	136.32	913,889.28	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	18.45	666,008.10	
	ALLEGRO.EU SA	39,203	24.27	951,652.82	
	DINO POLSKA SA	5,945	335.20	1,992,764.00	
	BANK PEKAO SA	27,684	80.04	2,215,827.36	
	M BANK SA	1,423	312.20	444,260.60	

	PKO BANK POLSKI SA	130,297	26.77	3,488,050.69
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	267.40	1,963,518.20
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	48,568	27.90	1,355,047.20
	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.36	353,984.88
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	6.01	381,610.96
	ポーランドズロチ 小計	526,059		23,209,919.69 (722,065,243)
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	-
	ロシアルーブル 小計	760,525,356		76.00 (183)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	6.27	2,062,830.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	9.72	2,352,240.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,343,400	3.38	11,300,692.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	460,000	22.45	10,327,000.00
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	236,000	3.26	769,360.00
	PETROCHINA CO LTD-H	2,648,000	3.30	8,738,400.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	196,000	23.75	4,655,000.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	2.68	911,200.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	23.10	3,337,950.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	6.70	1,467,300.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	5.39	2,220,680.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	3.39	976,320.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	3.08	2,494,800.00
	DONGYUE GROUP	147,000	8.27	1,215,690.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	66.95	3,617,978.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	67,000	10.10	676,700.00
	MMG LIMITED	304,000	2.12	644,480.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	5.16	1,878,240.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	95,000	13.76	1,307,200.00

ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	7.96	1,440,760.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	9.19	6,699,510.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.63	998,250.00
BOC AVIATION LTD	23,800	58.45	1,391,110.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	2.39	468,440.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	14.40	3,499,200.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	7.41	948,480.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	3.65	2,576,900.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	8.13	1,382,100.00
CITIC LTD	768,000	7.47	5,736,960.00
CRRC CORP LTD-H	409,000	2.75	1,124,750.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	5.19	1,494,720.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	16.96	1,322,880.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	7.58	1,212,800.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	8.46	461,070.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	8.49	1,798,182.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	7.58	1,070,417.28
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	34.85	2,171,155.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	3.06	355,572.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	3.12	1,201,430.88
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	6.30	1,348,200.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.55	1,128,400.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	10.40	1,721,688.80
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.41	776,160.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	9.45	4,895,572.50
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	4.96	1,243,839.04
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	5.83	1,877,260.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	127.30	2,227,750.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	6.25	889,918.75
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.36	1,661,600.00
BYD CO LTD-H	108,500	187.00	20,289,500.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	3.96	1,053,360.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	32.50	1,898,000.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	758,000	10.32	7,822,560.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	9.30	4,591,875.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	5.28	1,892,056.32
MINTH GROUP LTD	64,000	17.84	1,141,760.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	13.74	1,483,920.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	151,600	78.75	11,938,500.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.65	1,598,700.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	303,000	21.95	6,650,850.00
LI NING CO LTD	292,000	50.95	14,877,400.00

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	99,600	59.65	5,941,140.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	7.48	1,234,200.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	14.84	1,721,440.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	14.76	841,320.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	22.00	5,379,000.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	14.20	2,368,560.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.37	536,500.00
BAIDU INC-CLASS A	281,900	80.25	22,622,475.00
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	85.35	2,270,310.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	22.75	1,173,900.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	268,000	1.50	402,000.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	24.45	2,249,400.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	211,600	44.50	9,416,200.00
NETEASE INC	258,430	96.10	24,835,123.00
TENCENT HOLDINGS LTD	792,900	236.80	187,758,720.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,930,988	66.00	127,445,208.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	4.03	3,159,520.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	12.40	1,289,600.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	150,850	52.70	7,949,795.00
JD.COM INC - CL A	273,511	172.10	47,071,243.10
MEITUAN-CLASS B	558,900	144.30	80,649,270.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	16.18	868,866.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	12.66	817,836.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	4.31	491,340.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	35.90	3,302,800.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	105.49	1,603,448.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	5.17	2,915,880.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	402,000	30.25	12,160,500.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	208,000	45.55	9,474,400.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.49	858,540.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	227,600	41.80	9,513,680.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	11.02	2,148,900.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	11.10	2,530,800.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	88,000	64.75	5,698,000.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.28	502,400.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.51	3,085,600.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	17.84	856,320.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	33.10	2,896,250.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	16.80	420,000.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	35,200	41.20	1,450,240.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	4.45	551,800.00

MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	16.86	1,112,760.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	10.84	4,327,328.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	12.06	1,548,504.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	15.94	3,047,728.00
3SBIO INC	119,000	6.37	758,030.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	107.20	1,072,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	9.45	2,334,150.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,144,160	9.44	10,800,870.40
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.86	1,875,960.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	22.35	2,950,200.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	66.75	340,425.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	13.50	1,647,000.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	139,000	31.85	4,427,150.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	37.10	1,240,995.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	22.75	1,660,750.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,381,000	4.30	5,938,300.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	42,288	74.35	3,144,112.80
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	446,000	44.60	19,891,600.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,910,000	2.36	9,227,600.00
BANK OF CHINA LTD-H	10,228,200	2.64	27,002,448.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	4.11	5,636,762.25
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.10	2,948,720.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	12,187,620	4.45	54,234,909.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.14	802,500.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	494,923	30.20	14,946,674.60
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.42	1,632,048.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	7,043,515	3.60	25,356,654.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	4.15	4,394,850.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.82	682,240.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	3.35	1,618,050.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	203,600	12.08	2,459,488.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	13.96	3,989,419.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.40	1,296,000.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	8.91	789,426.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	4.19	1,496,668.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	8.29	2,205,140.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	918,000	9.62	8,831,160.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	14.74	5,698,484.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	6.23	1,146,469.52
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	14.82	1,428,648.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.31	2,169,090.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	889,288	7.57	6,731,910.16

PING AN INSURANCE GROUP CO-H	819,000	35.45	29,033,550.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	16.60	1,927,260.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	104,500	5.90	616,550.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	1.26	728,280.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	468,540	16.72	7,833,988.80
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	6.44	1,449,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	405,111	28.20	11,424,130.20
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	67,600	28.85	1,950,260.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	11.36	2,026,624.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,016,654	1.64	1,667,312.56
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	232,000	10.82	2,510,240.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	9.82	711,950.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	4.32	777,600.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	79,860	6.87	548,638.20
LONGFOR PROPERTIES	229,000	13.94	3,192,260.00
SEAZEN GROUP LTD	768,000	1.98	1,520,640.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00
WHARF HOLDINGS	154,000	27.35	4,211,900.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	7.43	858,908.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	6.50	1,794,000.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	9.86	1,249,262.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	13.60	4,229,600.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	88,000	4.51	396,880.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	13.08	1,033,320.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	16.64	1,189,760.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	22.75	1,376,375.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	22.45	1,504,150.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.26	500,940.00
LENOVO GROUP LTD	900,000	6.37	5,733,000.00
SUNNY OPTICAL TECH	92,900	85.70	7,961,530.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,906,200	10.08	19,214,496.00
ZTE CORP-H	82,908	14.88	1,233,671.04
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	0.78	3,561,480.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	22.40	1,332,800.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.85	1,128,500.00
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	1.70	2,427,600.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	7.79	3,633,256.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	9.90	4,474,800.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.74	1,824,840.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	23.05	2,443,300.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	13.10	3,371,940.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	98,600	85.00	8,381,000.00



	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	6.28	2,800,880.00
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	3.11	2,189,440.00
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	5.24	2,871,520.00
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	22.95	1,468,800.00
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	24.00	2,160,000.00
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	625,987	9.31	5,827,938.97
	香港ドル 小計	105,306,239		1,215,513,184.17 (22,669,320,884)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.04	843,882.72
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	21.60	542,160.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	8.55	2,307,645.00
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	480,200	4.44	2,132,088.00
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	6.28	239,896.00
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.20	739,961.20
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	6.00	639,564.00
	MISC BHD	217,540	7.18	1,561,937.20
	GENTING BHD	271,600	4.42	1,200,472.00
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.69	994,493.00
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.99	603,865.50
	IOI CORPORATION BHD	270,340	4.00	1,081,360.00
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	50,646	21.00	1,063,566.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	130.00	936,000.00
	PPB GROUP BERHAD	73,480	16.02	1,177,149.60
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.25	655,200.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.39	1,084,531.94
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	181,300	1.99	360,787.00
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.97	1,368,921.00
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	0.84	424,116.00
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.90	1,172,730.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	943,302	5.44	5,131,562.88
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	20.66	1,266,292.72
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	18.62	309,706.46
	MALAYAN BANKING BHD	571,105	8.63	4,928,636.15
	PUBLIC BANK BERHAD	1,870,400	4.40	8,229,760.00
	RHB BANK BHD	217,058	5.55	1,204,671.90
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.86	1,547,514.54
DIGI.COM BERHAD	498,000	3.86	1,922,280.00	
MAXIS BHD	267,900	3.86	1,034,094.00	
TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.45	1,479,958.40	
PETRONAS GAS BHD	75,500	16.98	1,281,990.00	
TENAGA NATIONAL BHD	305,275	8.30	2,533,782.50	

	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.48	681,256.00	
	マレーシアリングット 小計	10,735,816		52,681,831.71 (1,638,858,029)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	193.00	38,754,400.00	
	PTT PCL-NVDR	1,393,600	35.00	48,776,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	130,305	56.50	7,362,232.50	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	42.75	8,823,600.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	47.00	22,848,298.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	55.25	11,199,175.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	102,600	339.00	34,781,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	527,000	74.75	39,393,250.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	9.40	7,679,800.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	8.30	6,718,850.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	5.85	4,740,255.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	29.00	10,519,402.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	40.25	7,333,550.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	14.50	12,181,957.50	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	24.30	7,022,700.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	34.50	6,127,200.00	
	CP ALL PCL-NVDR	783,800	61.00	47,811,800.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	95.25	4,410,075.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	25.25	14,049,100.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	26.75	7,840,425.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	17.40	3,217,260.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	30.50	35,895,450.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	224.00	18,524,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	83,200	147.50	12,272,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	18.00	7,895,700.00	
	SCB X PCL-NVDR	88,700	105.50	9,357,850.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	15.20	2,509,520.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	72,600	63.25	4,591,950.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	58.50	5,937,750.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	34.75	3,120,550.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	41.75	3,185,525.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	68.75	15,558,125.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	9.30	8,109,600.00		
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	608.00	23,651,200.00		
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	153,200	188.00	28,801,600.00		
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	72.50	8,834,125.00		
TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	4.92	4,730,132.28		
B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	35.00	1,869,000.00		
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	171.50	2,898,350.00		

	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	97.00	21,330,300.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	65.25	4,450,050.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	51.25	20,648,625.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	81,450	40.75	3,319,087.50	
	タイパーツ 小計	14,994,371		599,082,019.78 (2,372,364,798)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	57.30	13,633,962.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	669.00	18,919,320.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	400.00	2,743,200.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	45.50	13,809,841.50	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	831.00	30,152,835.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	180.00	27,563,400.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	233.00	14,215,330.00	
	MONDE NISSIN CORP	490,500	12.00	5,886,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	125.00	11,945,000.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	94.80	20,146,422.00	
	BDO UNIBANK INC	219,911	132.00	29,028,252.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	52.25	8,427,245.75	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.55	8,362,735.00	
	AYALA LAND INC	794,100	26.05	20,686,305.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,567,750	33.30	52,206,075.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	320,000	11.10	3,552,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	5,044	2,298.00	11,591,112.00	
	PLDT INC	10,460	1,520.00	15,899,200.00	
	ACEN CORP	821,840	6.20	5,095,408.00	
MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	302.80	16,102,904.00		
	フィリピンペソ 小計	7,934,863		329,966,547.25 (832,637,585)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	3,640.00	7,870,772,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	31,000.00	6,227,900,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	964,000	1,870.00	1,802,680,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,000.00	1,971,600,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	805.00	2,320,412,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	10,150.00	2,478,630,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	4,220.00	6,850,313,340.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	7,175.00	2,182,635,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	7,875.00	2,721,600,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,542,000	6,550.00	16,650,100,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,680.00	5,731,716,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	5,925.00	4,694,377,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	22,600.00	1,346,960,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	9,750.00	1,569,750,000.00	

	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,550.00	2,810,605,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	4,540.00	5,254,596,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,960.00	8,209,460,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	7,015,200	8,875.00	62,259,900,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	474,900	4,850.00	2,303,265,000.00	
	BANK MANDIRI	2,513,096	10,150.00	25,507,924,400.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	9,300.00	7,534,860,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	8,723,602	4,650.00	40,564,749,300.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,140.00	3,238,284,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	6,241,700	4,190.00	26,152,723,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	2,350.00	2,528,835,000.00	
	インドネシアルピア 小計	50,876,795		250,784,648,040.00 (2,357,375,691)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	63,100.00	326,858,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	92,000.00	587,604,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,766	183,000.00	1,238,178,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	49,350.00	611,002,350.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	31,350.00	350,775,150.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	620,000.00	746,480,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	146,500.00	278,057,000.00	
	LG CHEM LTD	6,193	715,000.00	4,427,995,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	329,000.00	288,533,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	175,000.00	337,750,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	216,500.00	725,275,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	10,105	283,500.00	2,864,767,500.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,122	90,600.00	101,653,200.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	60,700.00	141,916,600.00	
	SKC CO LTD	1,734	106,500.00	184,671,000.00	
	CJ CORP	1,230	76,300.00	93,849,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	35,800.00	154,226,400.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	55,063	15,950.00	878,254,850.00	
	ECOPRO BM CO LTD	6,568	109,100.00	716,568,800.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	23,950.00	161,902,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	48,450.00	319,430,850.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	40,750.00	398,046,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	113,000.00	238,995,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,828	48,050.00	280,035,400.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	77,100.00	335,693,400.00	
	LG CORP	11,686	82,400.00	962,926,400.00	
	LG ENERGY SOLUTION	3,158	599,000.00	1,891,642,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	11,910	122,000.00	1,453,020,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	25,950.00	480,490,200.00	

SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	5,400.00	513,912,600.00
SK INC	4,545	223,500.00	1,015,807,500.00
S-1 CORPORATION	3,573	62,900.00	224,741,700.00
CJ LOGISTICS	862	86,800.00	74,821,600.00
HMM CO LTD	35,545	20,500.00	728,672,500.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	180,500.00	504,136,500.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	23,739	24,700.00	586,353,300.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,750.00	141,246,000.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	7,066	33,100.00	233,884,600.00
HANON SYSTEMS	19,000	8,190.00	155,610,000.00
HYUNDAI MOBIS	8,137	220,500.00	1,794,208,500.00
HYUNDAI MOTOR CO	16,824	169,500.00	2,851,668,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	82,600.00	499,069,200.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	81,200.00	280,058,800.00
KIA CORP	32,718	67,400.00	2,205,193,200.00
COWAY CO LTD	9,036	56,500.00	510,534,000.00
F&F CO LTD / NEW	3,017	150,500.00	454,058,500.00
HLB INC	10,012	37,100.00	371,445,200.00
LG ELECTRONICS INC	13,527	93,200.00	1,260,716,400.00
KANGWON LAND INC	7,703	23,550.00	181,405,650.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	9,880	23,650.00	233,662,000.00
CJ ENM CO LTD	830	79,000.00	65,570,000.00
HYBE CO LTD	2,474	130,500.00	322,857,000.00
KAKAO CORP	37,877	52,100.00	1,973,391,700.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	41,500.00	125,371,500.00
KRAFTON INC	3,554	195,000.00	693,030,000.00
NAVER CORP	17,071	180,000.00	3,072,780,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,939	411,000.00	796,929,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	47,600.00	117,334,000.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	43,350.00	199,626,750.00
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	67,000.00	292,321,000.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	89,400.00	92,439,600.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	178,500.00	291,312,000.00
EMART	3,594	90,000.00	323,460,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	417,500.00	323,562,500.00
KT&G CORP	18,829	94,400.00	1,777,457,600.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	98,100.00	308,230,200.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	112,500.00	423,225,000.00
LG H&H CO LTD	1,321	579,000.00	764,859,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	389	307,000.00	119,423,000.00
PACIFIC CORP	3,393	27,900.00	94,664,700.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,851	68,800.00	608,948,800.00

SD BIOSENSOR INC	3,909	32,700.00	127,824,300.00	
ALTEOGEN INC	3,409	37,750.00	128,689,750.00	
CELLTRION INC	12,283	187,500.00	2,303,062,500.00	
CELLTRION PHARM INC	1,968	68,000.00	133,824,000.00	
GREEN CROSS CORP	564	126,500.00	71,346,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,156	259,500.00	299,982,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,224	895,000.00	1,990,480,000.00	
SEEGENE INC	3,838	30,800.00	118,210,400.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	63,200.00	202,050,400.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	85,700.00	179,970,000.00	
YUHAN CORPORATION	12,567	57,300.00	720,089,100.00	
HANA FINANCIAL GROUP	41,045	41,200.00	1,691,054,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,550.00	298,881,500.00	
KAKAObANK CORP	18,421	23,200.00	427,367,200.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	48,657	49,100.00	2,389,058,700.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	59,426	37,400.00	2,222,532,400.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	77,054	11,800.00	909,237,200.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	53,800.00	247,587,600.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	7,939	28,550.00	226,658,450.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,475.00	214,370,400.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,640.00	205,939,600.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,300.00	112,595,100.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	33,650.00	194,362,400.00	
DB INSURANCE CO LTD	4,209	56,300.00	236,966,700.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	7,329	34,600.00	253,583,400.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	4,139	202,500.00	838,147,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	67,700.00	821,268,700.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	127,000.00	473,075,000.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,166	63,300.00	137,107,800.00	
L&F CO LTD	3,026	225,100.00	681,152,600.00	
LG DISPLAY CO LTD	38,301	14,250.00	545,789,250.00	
LG INNOTEK CO LTD	1,415	292,000.00	413,180,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,845	138,500.00	948,032,500.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	603,658	62,000.00	37,426,796,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	107,783	56,500.00	6,089,739,500.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	6,847	738,000.00	5,053,086,000.00	
LG UPLUS CORP	22,125	12,000.00	265,500,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	18,600.00	492,137,400.00	
SK HYNIX INC	68,932	89,200.00	6,148,734,400.00	
SK SQUARE CO LTD	11,660	39,100.00	455,906,000.00	
韓国ウォン 小計	2,048,046		125,879,970,950.00 (13,519,508,880)	

新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	83.30	9,349,592.00
	ASIA CEMENT CORP	234,176	38.50	9,015,776.00
	CHINA STEEL	1,494,261	27.80	41,540,455.80
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	70.50	29,614,300.50
	FORMOSA PLASTICS CORP	504,824	86.00	43,414,864.00
	NAN YA PLASTICS CORP	647,752	70.70	45,796,066.40
	TAIWAN CEMENT	648,419	31.90	20,684,566.10
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	841.00	15,606,437.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	32.65	11,363,114.20
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,470.00	13,230,000.00
	WALSIN LIHWA CORP	309,213	40.70	12,584,969.10
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	17.70	8,230,500.00
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	25.55	9,862,300.00
	EVERGREEN MARINE	123,215	148.50	18,297,427.50
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	28.20	13,310,400.00
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	72.00	5,373,720.00
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	64.50	13,996,500.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	33.45	5,922,690.45
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	428.00	8,533,036.00
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	173.00	12,187,504.00
	GIANT MANUFACTURING	34,464	222.50	7,668,240.00
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	248.00	7,688,000.00
	POU CHEN	273,780	28.70	7,857,486.00
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	42,000	593.00	24,906,000.00
	MOMO.COM INC	6,000	512.00	3,072,000.00
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	265.00	23,464,160.00
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	645,395	65.30	42,144,293.50
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	593,540	16.90	10,030,826.00
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,258,237	21.20	47,874,624.40
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,491,629	23.45	34,978,700.05
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,273,202	25.30	32,212,010.60
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,095,361	21.85	23,933,637.85
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,394,622	30.50	42,535,971.00
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,168,457	16.55	19,337,963.35
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,348,011	14.15	19,074,355.65
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,110,787	26.00	28,880,462.00
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	451,861	45.30	20,469,303.30
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	180,375	169.50	30,573,562.50
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,389,633	20.50	28,487,476.50
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,016,123	40.15	40,797,338.45
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,896,226	12.50	23,702,825.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	954,906	53.70	51,278,452.20	

SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	8.30	16,034,487.80
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	310,086	43.60	13,519,749.60
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70,000	254.00	17,780,000.00
ACER INC	255,803	24.20	6,190,432.60
ADVANTECH CO LTD	43,336	308.00	13,347,488.00
ASUSTEK COMPUTER INC	92,092	244.50	22,516,494.00
AUO CORP	756,072	17.90	13,533,688.80
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	176.50	20,950,550.00
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,390,080	13.20	18,349,056.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	21.80	9,412,368.00
DELTA ELECTRONICS INC	239,903	274.00	65,733,422.00
E INK HOLDINGS INC	94,000	195.00	18,330,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,585,248	102.50	162,487,920.00
INVENTEC CO LTD	280,511	23.95	6,718,238.45
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	1,955.00	29,403,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	66.60	15,015,103.20
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	120.50	12,050,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	234.50	4,924,500.00
PEGATRON CORP	200,474	58.40	11,707,681.60
QUANTA COMPUTER INC	286,270	69.10	19,781,257.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	54.30	10,974,030.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	141,000	145.00	20,445,000.00
WIWYNN CORP	8,000	875.00	7,000,000.00
WPG HOLDINGS LTD	260,692	46.30	12,070,039.60
YAGEO CORPORATION	43,588	424.00	18,481,312.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	114.00	15,723,108.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	505,315	109.00	55,079,335.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	69.10	14,925,600.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	94.90	23,269,480.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	427,315	86.80	37,090,942.00
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	660.00	1,980,000.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,255.00	7,530,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	402.00	9,648,000.00
MEDIATEK INC	196,804	650.00	127,922,600.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	58.10	6,681,500.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	74,045	285.00	21,102,825.00
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	703.00	5,624,000.00
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	301,000	32.70	9,842,700.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	284.00	17,592,096.00
SILERGY CORP	36,000	428.00	15,408,000.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,132,389	417.00	1,306,206,213.00
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,526,000	41.45	63,252,700.00



	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	73.00	6,497,000.00
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	141.00	4,512,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	21.00	7,329,000.00
	新台湾ドル 小計	42,084,987		3,242,855,025.05 (14,907,080,264)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	306.80	29,520,602.80
	COAL INDIA LTD	180,326	255.95	46,154,439.70
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	204.65	12,161,326.25
	INDIAN OIL CORP LTD	290,647	69.60	20,229,031.20
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	381,562	138.65	52,903,571.30
	PETRONET LNG LTD	83,779	209.50	17,551,700.50
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	387,099	2,603.00	1,007,618,697.00
	ACC LTD	5,315	2,435.30	12,943,619.50
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	564.30	41,494,671.90
	ASIAN PAINTS LTD	46,971	3,087.10	145,004,174.10
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	589.15	17,349,878.35
	GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,744.45	55,000,764.05
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	417.00	75,268,917.00
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	481.05	33,564,782.70
	JSW STEEL LTD	99,332	706.45	70,173,091.40
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,620.00	46,325,140.00
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,650.40	48,234,629.60
	SHREE CEMENT LTD	1,387	23,082.95	32,016,051.65
	SRF LTD	19,164	2,390.85	45,818,249.40
	TATA STEEL LTD	940,850	106.15	99,871,227.50
	ULTRATECH CEMENT LTD	13,371	6,904.80	92,324,080.80
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	753.75	52,499,441.25
	VEDANTA LTD	107,173	307.60	32,966,414.80
	ADANI ENTERPRISES LTD	34,272	3,997.15	136,990,324.80
	BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	108.05	54,825,110.25
	HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,204.25	42,950,780.50
	LARSEN & TOUBRO LTD	82,638	2,003.85	165,594,156.30
	SIEMENS INDIA LTD	11,025	2,914.65	32,134,016.25
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	761.20	17,502,271.60
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	64,743	891.20	57,698,961.60
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	808.20	21,380,931.00
	INTERGLOBE AVIATION LTD	14,831	1,718.30	25,484,107.30
	BAJAJ AUTO LTD	9,644	3,737.85	36,047,825.40
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	1,935.85	17,095,491.35	
BHARAT FORGE LTD	30,322	878.60	26,640,909.20	
EICHER MOTORS LTD	17,872	3,732.80	66,712,601.60	
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,651.60	32,450,280.80	

MAHINDRA & MAHINDRA LTD	110,799	1,337.20	148,160,422.80
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	15,707	9,248.85	145,271,686.95
MRF LTD	432	87,056.90	37,608,580.80
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	186,639	68.35	12,756,775.65
TATA MOTORS LTD	218,977	433.00	94,817,041.00
PAGE INDUSTRIES LTD	886	49,566.25	43,915,697.50
TITAN CO LTD	46,501	2,718.00	126,389,718.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	566.45	24,884,148.50
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	3,883.30	30,503,321.50
TRENT LTD	19,255	1,501.30	28,907,531.50
ZOMATO LTD	427,818	65.30	27,936,515.40
AVENUE SUPERMARTS LTD	21,281	4,156.55	88,455,540.55
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	14,526	4,172.45	60,609,008.70
ITC LTD	345,135	360.50	124,421,167.50
MARICO LTD	81,711	502.35	41,047,520.85
NESTLE INDIA LIMITED	3,906	20,322.65	79,380,270.90
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	770.25	46,995,263.25
UNITED SPIRITS LTD	32,483	877.10	28,490,839.30
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,584.45	15,156,848.70
DABUR INDIA LTD	79,726	553.95	44,164,217.70
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	815.35	51,689,928.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	104,076	2,510.15	261,246,371.40
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	13,485	4,360.75	58,804,713.75
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	541.40	19,173,681.00
BIOCON LTD	58,256	278.75	16,238,860.00
CIPLA LTD	59,934	1,129.20	67,677,472.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	3,298.15	48,753,253.30
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,540.60	57,411,346.40
LUPIN LTD	26,552	694.05	18,428,415.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	122,226	1,012.75	123,784,381.50
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,652.25	20,190,495.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	642.80	19,370,135.20
AXIS BANK LTD	288,046	874.35	251,853,020.10
BANDHAN BANK LTD	74,811	228.70	17,109,275.70
ICICI BANK LTD	653,260	911.15	595,217,849.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	73,561	1,896.45	139,504,758.45
STATE BANK OF INDIA	226,932	615.55	139,687,992.60
YES BANK LTD	1,020,164	16.55	16,883,714.20
BAJAJ FINANCE LTD	34,450	7,145.50	246,162,475.00
BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,753.50	96,442,500.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	54,812	744.50	40,807,534.00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	219,370	2,502.90	549,061,173.00

	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,118.60	13,896,367.80
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	812.80	25,207,366.40
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,275.30	27,056,764.80
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	129,053	531.75	68,623,932.75
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,154.15	38,815,218.65
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	500.65	15,886,625.80
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,264.10	67,970,657.00
	DLF LTD	87,983	397.00	34,929,251.00
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,168.50	14,867,994.00
	HCL TECHNOLOGIES LTD	139,804	1,052.90	147,199,631.60
	INFOSYS LTD	428,668	1,510.25	647,395,847.00
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	4,831.40	27,809,538.40
	MINDTREE LTD	6,247	3,482.35	21,754,240.45
	MPHASIS LTD	7,796	1,949.20	15,195,963.20
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	117,320	3,215.95	377,295,254.00
	TATA ELXSI LTD	4,179	6,991.70	29,218,314.30
	TECH MAHINDRA LTD	72,109	1,029.10	74,207,371.90
	WIPRO LTD	179,580	390.95	70,206,801.00
	BHARTI AIRTEL LTD	294,891	817.65	241,117,626.15
	INDUS TOWERS LTD	90,578	192.80	17,463,438.40
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	2,214.85	94,308,313.00
	ADANI POWER LTD	85,623	365.20	31,269,519.60
	ADANI TOTAL GAS LTD	33,068	3,795.85	125,521,167.80
	ADANI TRANSMISSION LTD	32,827	3,277.35	107,585,568.45
	GAIL INDIA LTD	262,152	88.50	23,200,452.00
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	416.70	11,135,890.80
	NTPC LTD	664,141	173.45	115,195,256.45
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	380,361	218.75	83,203,968.75
	TATA POWER CO LTD	199,512	231.40	46,167,076.80
	インドルピー 小計	12,546,123		9,539,579,152.60 (17,266,638,266)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	19.75	1,183,301.50
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.14	1,947,030.85
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.28	1,012,149.00
	INDUSTRIES QATAR	196,788	15.87	3,123,025.56
	COMMERCIAL BANK QSC	326,034	6.28	2,049,775.75
	MASRAF AL RAYAN	732,376	3.82	2,802,070.57
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	12.45	1,227,059.55
	QATAR ISLAMIC BANK	206,340	25.09	5,177,070.60
	QATAR NATIONAL BANK	590,025	20.49	12,089,612.25
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.45	715,840.50
	OORED00 QSC	72,800	10.45	760,760.00

	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	19.49	1,881,018.88	
	カタールリアル 小計	3,500,493		33,968,715.01 (1,355,351,728)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	219.00	7,493,523.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	275.38	4,039,824.60	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	5,906	1,607.52	9,494,013.12	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	51,324	295.18	15,149,818.32	
	GOLD FIELDS LTD	120,051	184.50	22,149,409.50	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	57.44	3,233,929.44	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	114,090	201.44	22,982,289.60	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	417.60	2,243,347.20	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	178.00	8,556,282.00	
	SASOL LTD	72,299	304.25	21,996,970.75	
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	44.68	17,645,204.32	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	216.41	5,994,989.82	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	120.13	4,868,748.77	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	183.12	5,220,751.20	
	NASPERS LTD-N SHS	27,673	2,106.20	58,284,872.60	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	144,533	23.49	3,395,080.17	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	115.19	4,325,845.26	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	65.10	7,193,224.50	
	BID CORP LTD	43,999	298.81	13,147,341.19	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	305.13	10,808,314.86	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	60,003	236.94	14,217,110.82	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	161.00	3,747,114.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	151.95	8,536,854.90	
	ABSA GROUP LTD	109,198	197.77	21,596,088.46	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	11,355	1,914.41	21,738,125.55	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	221.83	13,999,913.13	
	STANDARD BANK GROUP LTD	173,745	177.03	30,758,077.35	
	FIRSTRAND LTD	617,542	66.78	41,239,454.76	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	295.65	5,081,336.55	
	REMGRO LTD	74,679	140.76	10,511,816.04	
	DISCOVERY LIMITED	59,544	124.29	7,400,723.76	
OLD MUTUAL LTD	489,612	10.68	5,229,056.16		
SANLAM LTD	214,053	53.69	11,492,505.57		
NEPI ROCKCASTLE N.V.	60,556	95.36	5,774,620.16		
MTN GROUP LTD	219,239	135.38	29,680,575.82		
VODACOM GROUP	84,493	128.55	10,861,575.15		
	南アフリカランド 小計	3,747,413		490,088,728.40 (4,038,331,122)	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	4.50	1,998,099.00	

アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	9.63	3,149,375.94	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	9.49	1,763,061.69	
	DUBAI ISLAMIC BANK	335,455	5.84	1,959,057.20	
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	13.20	3,567,432.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	529,392	18.38	9,730,224.96	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	487,034	4.57	2,225,745.38	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	576,832	6.26	3,610,968.32	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	435,702	25.70	11,197,541.40	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		3,591,516		39,201,505.89	(1,565,316,130)
クウェートディ ナール	AGILITY	157,695	0.81	128,521.42	
	BOUBYAN BANK K.S.C	152,875	0.83	128,109.25	
	GULF BANK	137,143	0.35	48,274.33	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	932,130	0.85	793,242.63	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	893,182	1.13	1,011,082.02	
	MABANEE CO KPSC	133,798	0.90	120,819.59	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.60	180,769.47	
クウェートディナール 小計		2,703,653		2,410,818.71	(1,143,403,097)
オフショア人民 元	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	29.41	588,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	5.02	502,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	20.70	1,991,340.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	12.22	972,712.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	17.11	1,502,258.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	34.23	958,440.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	20,700	42.16	872,712.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	4.25	698,275.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	26.01	765,734.40	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	5.11	197,757.00	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	48.82	1,005,692.00	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	12,447	20.10	250,184.70	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	13.10	1,207,820.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	28.01	582,608.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	89.19	998,928.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	48.90	1,213,991.40	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	16.10	597,310.00	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	7.02	1,035,450.00	
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	2,400	102.42	245,808.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	14.34	143,400.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.93	889,730.00		
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.22	253,200.00		
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	13.47	300,381.00		

JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	100.00	780,000.00
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	10.25	311,600.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	17.01	260,253.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	19.63	924,573.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	13.46	1,066,032.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	5.41	105,495.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	26.25	1,249,500.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	12.05	583,822.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	14.14	784,416.50
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	18.68	135,467.36
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	28.04	503,037.60
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.33	954,378.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	11,200	57.70	646,240.00
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	9.44	1,035,360.32
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	4.28	588,072.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	15.31	754,783.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	41.05	443,340.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	600	310.16	186,096.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	19.60	978,040.00
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A	16,100	69.40	1,117,340.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	105.39	1,201,446.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	13.35	130,830.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	2.90	961,640.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	5.80	534,760.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	82.32	1,440,600.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	74.01	682,372.20
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	11,775	105.65	1,244,028.75
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	14.74	1,640,562.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,400	150.50	210,700.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	168.11	689,251.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	31.57	1,180,718.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	65.33	484,095.30
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	43,000	24.41	1,049,630.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	105,600	9.29	981,024.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	46.31	527,934.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	43.22	669,910.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	22.79	191,436.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	12.35	790,400.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	25.89	1,429,516.35
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.35	1,417,285.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	4.91	1,035,519.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	17,700	397.06	7,027,962.00

CRRG CORP LTD-A	185,800	5.18	962,444.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	24.91	1,076,112.00
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	95.05	719,813.65
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	6.62	150,936.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	209.01	501,624.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	34.53	200,274.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	86.67	546,021.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	35.47	933,570.40
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	60.56	693,775.36
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	20.84	856,524.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	18.00	865,800.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.08	1,019,172.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	24.88	900,656.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	69,984	26.19	1,832,880.96
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	3,300	381.20	1,257,960.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	75.00	940,050.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	89.18	1,041,176.50
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	21.75	878,700.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	7.27	1,186,464.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	332.57	915,232.64
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	15.05	630,595.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	68.41	1,942,365.13
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	17,900	11.09	198,511.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	126.02	1,260,200.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	25.46	1,036,222.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	511.01	1,308,185.60
TBEA CO LTD-A	22,519	21.80	490,914.20
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	9.94	429,408.00
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	5,320	140.01	744,853.20
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	4.76	949,144.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	11.26	226,449.86
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	28.69	906,604.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	47.20	389,872.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	8.62	777,524.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	5.57	446,157.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	42,581	5.04	214,608.24
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	45.92	505,120.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	10.86	281,274.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	338,800	4.79	1,622,852.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.23	209,200.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	6.54	1,049,670.00
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	50.00	1,015,000.00

SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	58.93	313,448.67
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.27	233,988.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	18.90	1,052,730.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	12.46	272,126.40
BYD CO LTD -A	9,700	269.63	2,615,411.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	137.74	1,239,660.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	12.45	539,732.40
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	37.31	690,235.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	17.69	606,767.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	121.10	1,017,240.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	16.15	473,195.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	73.33	51,331.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.28	608,328.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	18.75	736,012.50
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	1,443	249.15	359,523.45
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	67.47	188,916.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	30.26	1,316,310.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	22.41	622,101.60
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	32.60	258,583.20
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	90.90	699,930.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	22.42	582,920.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	4.18	426,360.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	42.52	340,160.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	53.85	1,410,870.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	4.55	360,815.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	13.29	444,949.20
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	15.25	373,625.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	7.46	399,856.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.16	719,304.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	299.00	867,100.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	24.50	399,350.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	12.05	274,740.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	3.87	238,005.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	189.11	2,307,142.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	6.81	752,505.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	18,576	36.50	678,024.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	61.55	624,117.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	39.24	419,868.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	215.10	344,160.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	44.10	97,020.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	47.15	862,845.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	156.71	470,130.00



BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	9.40	559,300.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	25.96	267,388.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	46.35	463,500.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	106.06	837,874.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	24.13	110,998.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	20,248	69.22	1,401,566.56
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	25.50	698,700.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	57.74	981,580.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	24.09	28,908.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	27.21	933,357.42
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	40.87	707,051.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	135.09	1,229,319.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	3.89	107,753.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	121.50	680,400.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	33.04	379,960.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	57.74	404,180.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	9,200	1,459.90	13,431,080.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	175.50	1,719,900.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	48.10	1,614,139.80
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	13.24	354,832.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	252.72	2,370,513.60
TONGWEI CO LTD-A	31,600	45.55	1,439,380.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	18.10	690,696.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	30,200	145.40	4,391,080.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	40.66	410,666.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	15.74	83,422.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	17.98	534,006.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	70,574	26.00	1,834,924.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	74.11	210,324.18
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	42.36	411,739.20
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	9,450	23.35	220,657.50
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	33.07	408,414.50
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	12.73	132,392.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	24.62	364,376.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	4.99	123,951.60
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	31.91	230,039.19
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	306.50	2,574,600.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	131.62	263,240.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	9.24	349,549.20
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	152.00	42,560.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	28,080	21.21	595,576.80
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	47.45	1,347,580.00

BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	7,491	128.00	958,848.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	49.31	793,891.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	58.00	319,000.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	107.98	979,054.66
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	171.77	377,894.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	54.55	556,410.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	99.44	984,456.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	38.61	856,871.73
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	28.36	453,760.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	92.40	739,200.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	18.25	344,012.50
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	482.10	1,002,768.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	40.75	1,552,656.50
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	11,116	63.20	702,531.20
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	17.21	476,407.22
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	69.00	1,316,382.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	5.61	359,601.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	35.17	382,649.60
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	32.98	230,860.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	35.00	330,400.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	24.36	273,611.52
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	41.88	711,960.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	82.53	1,358,773.92
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	54.51	541,829.40
ZHANGZHOU PIENZTEHUANG PHA-A	3,900	256.45	1,000,155.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	20.62	185,992.40
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	19.20	669,081.60
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	51.51	499,647.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	2.75	972,400.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.07	236,060.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.54	449,006.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	12.26	1,381,702.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	6.83	1,569,124.20
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	9.60	1,416,000.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	25.79	1,503,557.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	5.70	259,350.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	5.27	658,223.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	2.79	359,631.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	137,700	29.18	4,018,086.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.39	927,504.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	2.85	879,510.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	4.89	583,866.00

IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	4.10	2,372,260.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	15.49	1,474,648.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	10.89	1,300,266.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.08	577,320.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	6.79	939,057.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.09	378,525.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	10.89	864,666.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.26	416,215.80
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.38	107,062.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.43	393,681.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	12.85	368,281.00
CITIC SECURITIES CO-A	49,680	18.25	906,660.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	24.74	596,234.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	97,856	17.03	1,666,487.68
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	14.34	51,624.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.70	343,140.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	6.82	564,696.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	14.51	879,306.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	171,679	5.91	1,014,622.89
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	13.44	971,712.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.70	1,018,735.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	88.28	476,712.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	12.33	388,395.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	5.71	652,481.70
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	8.22	350,994.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	8.22	333,534.72
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.00	828,800.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.81	434,340.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.29	449,673.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	21.08	383,656.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	38.37	2,563,116.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	13.91	760,877.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	14.55	781,335.00
GEMDALE CORP-A	45,500	8.62	392,210.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	566,400	2.05	1,161,120.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	14.35	1,173,830.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	16.23	207,744.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	11.74	99,790.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	7.09	190,721.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	272.50	1,314,267.50
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	26,460	14.30	378,378.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	8.77	252,576.00

DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.07	338,099.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	39.65	656,683.30
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	34.53	372,924.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	12.13	402,716.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	124.00	372,000.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	7,943	41.57	330,190.51
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	118.71	652,905.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	24.61	324,113.70
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	30.22	1,145,338.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.53	404,538.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	30.03	840,840.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	10.99	382,452.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	123.50	1,123,850.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	13.77	286,416.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	8.64	389,664.00
GOERTEK INC -A	26,900	20.72	557,368.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	4.83	241,500.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	64.40	450,800.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	22.36	440,760.32
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	10.15	170,520.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	32.08	1,490,116.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	103.35	178,588.80
NINESTAR CORP-A	18,543	56.26	1,043,229.18
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	5.37	168,081.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	14.22	345,546.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	75.65	360,094.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	67.50	434,362.50
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	27.74	790,590.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.07	426,290.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	17.20	315,448.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	20,100	38.50	773,850.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	51.82	217,644.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	41,316	11.95	493,726.20
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	172.41	810,327.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	67.36	757,800.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	11.84	358,752.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	29.46	256,302.00
ZTE CORP-A	12,600	22.95	289,170.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	5.98	1,039,324.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	5.67	1,368,171.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	20.12	3,619,185.60
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	16.73	930,188.00

	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	4.22	1,332,254.00
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	10.22	690,872.00
	SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	92,300	11.28	1,041,144.00
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	107.78	764,914.66
	AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	62.08	629,367.04
	CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	51.71	1,087,564.72
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	3.37	278,025.00
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	88.16	552,939.52
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	15,120	66.85	1,010,772.00
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	33.42	250,650.00
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	70.98	532,350.00
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	24,430	67.38	1,646,093.40
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	23.78	708,644.00
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	47,040	49.96	2,350,118.40
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	64.00	1,347,520.00
	NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	64,153	20.06	1,286,909.18
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	249.60	773,760.00
	SG MICRO CORP-A	3,150	154.40	486,360.00
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	142.50	1,125,750.00
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	357.27	1,000,356.00
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	29,500	44.33	1,307,735.00
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	8.81	288,527.50
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	18.98	426,404.68
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	71.21	1,810,015.78
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	153.85	1,055,257.15
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	79.98	583,054.20
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	54.62	775,604.00
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	73.38	1,249,074.36
	オフショア人民元 小計	17,756,869		281,743,195.53 (5,673,209,159)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	11.46	515,000.94
	SAUDI ARABIAN OIL CO	306,676	34.30	10,518,986.80
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	44.00	518,100.00
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	12.22	390,160.16
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	28,237	150.00	4,235,550.00
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	39.05	1,844,761.05
	SAUDI ARABIAN MINING CO	106,575	73.00	7,779,975.00
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	119,170	84.30	10,046,031.00
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,414	21.28	817,449.92
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	11.76	1,216,348.56
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	43.75	1,161,825.00
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	199.60	839,717.20

JARIR MARKETING CO	12,500	164.00	2,050,000.00	
ALMARAI CO	30,130	57.00	1,717,410.00	
SAVOLA	25,336	29.05	736,010.80	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	216.80	2,540,245.60	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	182.40	1,452,268.80	
AL RAJHI BANK	248,500	85.30	21,197,050.00	
ALINMA BANK	124,211	38.60	4,794,544.60	
ARAB NATIONAL BANK	86,031	34.50	2,968,069.50	
BANK AL-JAZIRA	35,813	23.44	839,456.72	
BANK ALBILAD	61,145	52.90	3,234,570.50	
BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	42.95	2,900,671.20	
RIYAD BANK	166,012	37.00	6,142,444.00	
SAUDI BRITISH BANK	116,762	43.00	5,020,766.00	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	18.44	1,302,601.60	
THE SAUDI NATIONAL BANK	276,263	57.20	15,802,243.60	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	3,929	209.80	824,304.20	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	182.40	1,105,891.20	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	13.22	1,335,101.02	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.03	417,068.61	
ELM CO	2,436	312.20	760,519.20	
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	37.15	1,814,554.60	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	11.70	1,058,943.60	
SAUDI TELECOM CO	183,517	38.80	7,120,459.60	
ACWA POWER CO	9,184	154.60	1,419,846.40	
SAUDI ELECTRICITY CO	111,901	26.45	2,959,781.45	
サウジアラビアリアル 小計	2,813,267		131,398,728.43 (5,124,550,408)	
合 計	1,091,331,244		109,447,934,805 (109,447,934,805)	

## (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	7,483,376.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	7,483,376.00 (56,027,287)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	3,706,985.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,340,739.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,759,296.00	
		KLABIN SA-UNIT	100,000	2,253,000.00	
			314,800	9,060,020.00	

	ブラジルリアル 小計			(255,022,348)	
投資信託受益証券合計			373,200	311,049,635	(311,049,635)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	9,009,100.00	
	メキシコペソ 小計		391,700	9,009,100.00	(67,450,230)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	6,367,148.90	
	南アフリカランド 小計		478,733	6,367,148.90	(52,465,306)
投資証券合計			870,433	119,915,536	(119,915,536)
合計				430,965,171	(430,965,171)

(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	95.6%			2.4%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.0%		0.1%
	投資証券 1銘柄			2.4%	0.1%
ブラジルリアル	株式 45銘柄	96.1%			5.7%
	投資信託受 益証券 4銘柄		3.9%		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%			0.2%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 12銘柄	100.0%			0.5%
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 14銘柄	100.0%			0.7%
ロシアルーブル	株式 14銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式 194銘柄	100.0%			20.6%

マレーシアリングット	株式	34銘柄	100.0%			1.5%
タイバーツ	株式	43銘柄	100.0%			2.2%
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%			2.1%
韓国ウォン	株式	111銘柄	100.0%			12.3%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%			13.6%
インドルピー	株式	108銘柄	100.0%			15.7%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			1.2%
南アフリカランド	株式	36銘柄	98.7%			3.7%
	投資証券	1銘柄			1.3%	0.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	9銘柄	100.0%			1.4%
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	345銘柄	100.0%			5.2%
サウジアラビアリアル	株式	37銘柄	100.0%			4.7%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2022年11月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,222,455,544
国債証券	521,563,440,150
地方債証券	32,371,191,103
特殊債証券	36,528,164,013
社債証券	27,860,862,660
未収入金	349,446,640
未収利息	1,053,401,910
前払費用	16,477,273
流動資産合計	620,965,439,293
資産合計	620,965,439,293
負債の部	
流動負債	



	2022年11月10日現在
項目	金額（円）
未払金	895,199,700
未払解約金	366,895,207
未払利息	2,760
流動負債合計	1,262,097,667
負債合計	1,262,097,667
純資産の部	
元本等	
元本	457,318,723,729
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	162,384,617,897
元本等合計	619,703,341,626
純資産合計	619,703,341,626
負債純資産合計	620,965,439,293

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2022年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	457,318,723,729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 100,079,000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 1.3551円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,551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11月10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11月10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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月11日
期首元本額	451,375,915,149円
期中追加設定元本額	19,819,534,998円
期中一部解約元本額	13,876,726,418円
期末元本額	457,318,723,729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）	4,180,586,683円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,985,222円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,632,201,656円
世界経済インデックスファンド	4,248,007,951円
D C マイセレクション 2 5	26,190,667,499円
D C マイセレクション 5 0	30,177,548,657円
D C マイセレクション 7 5	8,850,317,152円
D C 日本債券インデックス・オープン	436,777,728円
D C 日本債券インデックス・オープン S	91,827,365,048円
D C 日本債券インデックス・オープン P	66,826,530,966円
D C マイセレクション S 2 5	13,473,540,730円
D C マイセレクション S 5 0	15,056,468,411円
D C マイセレクション S 7 5	3,440,034,586円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	679,268,992円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,331,720,779円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	889,365,693円
D C 世界経済インデックスファンド	3,587,335,005円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,776,723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11月10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)	114,094,313円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	33,072,477円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	26,584,747円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,646,260,053円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	737,228,793円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,066,500,321円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	69,138,299円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	53,630,520円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	952,822,652円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,073,664,997円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,386,319,772円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	135,308,704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	16,952,141,850円
分散投資コア戦略ファンドA	19,691,639,158円
分散投資コア戦略ファンドS	24,369,075,300円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	180,178,999円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,470,139,238円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	73,402,891円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	37,271,175円
SMT インデックスバランス・オープン	61,423,535円
SMT 世界経済インデックス・オープン	42,309,785円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	82,952,461円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	132,746,316円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,171,756円
グローバル経済コア	233,815,016円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	35,152,816円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	21,175,973円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	37,538,143円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	21,061,415円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	5,409,078円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	3,860,827円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	16,925,562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)	84,503,868,494円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	91,036,501円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	17,337,975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)	395,265,934円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	13,402,130,950	
地方債証券	465,657,207	
特殊債券	567,010,603	
社債券	469,402,720	
合計	14,904,201,480	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第432回利付国債(2年)	1,550,000,000	1,551,674,000	
	第433回利付国債(2年)	1,910,000,000	1,911,986,400	
	第434回利付国債(2年)	1,915,000,000	1,916,991,600	
	第435回利付国債(2年)	2,730,000,000	2,732,839,200	
	第436回利付国債(2年)	1,470,000,000	1,471,617,000	
	第437回利付国債(2年)	3,170,000,000	3,173,423,600	
	第438回利付国債(2年)	540,000,000	540,572,400	
	第439回利付国債(2年)	470,000,000	470,521,700	
	第440回利付国債(2年)	1,930,000,000	1,932,084,400	
	第441回利付国債(2年)	350,000,000	350,493,500	
	第138回利付国債(5年)	6,890,000,000	6,904,882,400	
	第139回利付国債(5年)	5,590,000,000	5,602,857,000	
	第140回利付国債(5年)	4,660,000,000	4,671,976,200	
	第141回利付国債(5年)	7,650,000,000	7,672,032,000	
	第142回利付国債(5年)	4,250,000,000	4,263,855,000	
	第143回利付国債(5年)	4,750,000,000	4,767,337,500	
	第144回利付国債(5年)	5,230,000,000	5,251,129,200	

第145回利付国債(5年)	5,590,000,000	5,614,763,700	
第146回利付国債(5年)	4,120,000,000	4,139,858,400	
第147回利付国債(5年)	4,170,000,000	4,177,672,800	
第148回利付国債(5年)	6,770,000,000	6,780,967,400	
第149回利付国債(5年)	4,820,000,000	4,824,627,200	
第150回利付国債(5年)	6,860,000,000	6,861,372,000	
第151回利付国債(5年)	4,000,000,000	3,997,360,000	
第152回利付国債(5年)	210,000,000	210,728,700	
第153回利付国債(5年)	5,090,000,000	5,080,634,400	
第154回利付国債(5年)	1,010,000,000	1,011,706,900	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	489,028,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,327,015,500	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	646,618,500	
第4回利付国債(40年)	950,000,000	1,111,015,500	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,203,557,400	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,376,600,400	
第7回利付国債(40年)	1,240,000,000	1,294,262,400	
第8回利付国債(40年)	1,490,000,000	1,441,828,300	
第9回利付国債(40年)	2,260,000,000	1,593,932,800	
第10回利付国債(40年)	2,100,000,000	1,745,100,000	
第11回利付国債(40年)	1,525,000,000	1,219,222,250	
第12回利付国債(40年)	1,290,000,000	917,448,000	
第13回利付国債(40年)	2,120,000,000	1,496,062,800	
第14回利付国債(40年)	2,130,000,000	1,605,657,900	
第15回利付国債(40年)	1,220,000,000	1,006,756,200	
第332回利付国債(10年)	4,600,000,000	4,635,420,000	
第333回利付国債(10年)	3,320,000,000	3,350,112,400	
第334回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,305,156,000	
第335回利付国債(10年)	2,310,000,000	2,333,816,100	
第336回利付国債(10年)	1,210,000,000	1,224,157,000	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,820,944,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,608,883,200	
第339回利付国債(10年)	4,670,000,000	4,725,432,900	
第340回利付国債(10年)	4,430,000,000	4,487,678,600	
第341回利付国債(10年)	5,220,000,000	5,277,628,800	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,783,942,800	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,683,483,500	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,927,317,000	
第345回利付国債(10年)	3,780,000,000	3,795,498,000	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,769,952,500	
第347回利付国債(10年)	3,550,000,000	3,559,762,500	
第348回利付国債(10年)	4,460,000,000	4,467,537,400	

第349回利付国債(10年)	5,000,000,000	5,006,350,000	
第350回利付国債(10年)	6,390,000,000	6,395,048,100	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,840,000,000	4,841,306,800	
第352回利付国債(10年)	4,390,000,000	4,388,683,000	
第353回利付国債(10年)	5,415,000,000	5,408,393,700	
第354回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,779,414,100	
第355回利付国債(10年)	3,970,000,000	3,958,288,500	
第356回利付国債(10年)	4,280,000,000	4,263,992,800	
第357回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,755,402,100	
第358回利付国債(10年)	3,260,000,000	3,236,365,000	
第359回利付国債(10年)	3,660,000,000	3,627,133,200	
第360回利付国債(10年)	4,890,000,000	4,840,904,400	
第361回利付国債(10年)	4,600,000,000	4,550,596,000	
第362回利付国債(10年)	3,750,000,000	3,706,987,500	
第363回利付国債(10年)	5,250,000,000	5,185,792,500	
第364回利付国債(10年)	5,210,000,000	5,142,270,000	
第365回利付国債(10年)	6,360,000,000	6,283,425,600	
第366回利付国債(10年)	5,740,000,000	5,747,863,800	
第367回利付国債(10年)	5,360,000,000	5,339,846,400	
第368回利付国債(10年)	1,770,000,000	1,762,318,200	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	129,829,700	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	185,512,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	138,670,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	133,350,800	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	58,255,500	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	417,147,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	214,313,400	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	401,117,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	265,504,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	172,161,600	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	295,739,600	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	224,192,400	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	468,060,000	
第14回利付国債(30年)	800,000,000	971,648,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	417,333,000	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	245,738,000	
第17回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,401,827,000	
第18回利付国債(30年)	315,000,000	380,526,300	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	640,467,900	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	592,396,800	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	605,490,000	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	668,077,200	

第23回利付国債(30年)	430,000,000	532,430,300
第24回利付国債(30年)	780,000,000	966,505,800
第25回利付国債(30年)	600,000,000	727,926,000
第26回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,704,862,800
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,381,894,400
第28回利付国債(30年)	2,090,000,000	2,593,564,600
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,046,000,500
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,140,018,500
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,311,222,000
第32回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,642,077,600
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,106,923,000
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,135,637,150
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	2,658,570,000
第36回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,463,387,600
第37回利付国債(30年)	2,255,000,000	2,565,716,450
第38回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,578,072,000
第39回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,658,983,400
第40回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,384,906,400
第41回利付国債(30年)	1,230,000,000	1,349,482,200
第42回利付国債(30年)	1,280,000,000	1,403,084,800
第43回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,390,878,600
第44回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,389,570,500
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,518,120,000
第46回利付国債(30年)	1,810,000,000	1,905,694,700
第47回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,595,968,800
第48回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,792,774,200
第49回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,645,968,000
第50回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,512,268,500
第51回利付国債(30年)	1,640,000,000	1,314,099,200
第52回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,391,561,400
第53回利付国債(30年)	1,320,000,000	1,128,639,600
第54回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,536,751,200
第55回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,281,873,600
第56回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,312,612,000
第57回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,245,890,100
第58回利付国債(30年)	2,330,000,000	2,051,122,300
第59回利付国債(30年)	1,380,000,000	1,180,120,800
第60回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,378,115,200
第61回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,230,064,000
第62回利付国債(30年)	340,000,000	272,183,600
第63回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,231,629,900
第64回利付国債(30年)	1,760,000,000	1,358,139,200
第65回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,084,168,250



第66回利付国債(30年)	1,110,000,000	854,122,800	
第67回利付国債(30年)	1,865,000,000	1,504,999,050	
第68回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,198,272,900	
第69回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,106,170,000	
第70回利付国債(30年)	2,270,000,000	1,867,869,500	
第71回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,173,972,800	
第72回利付国債(30年)	1,150,000,000	941,942,000	
第73回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,531,212,100	
第74回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,543,815,000	
第75回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,281,107,000	
第76回利付国債(30年)	600,000,000	585,810,000	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	224,862,000	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	336,926,700	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	133,468,400	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	195,842,500	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	401,462,100	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	415,812,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	207,262,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	655,244,100	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	375,602,400	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	209,090,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	136,601,400	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	282,436,200	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	304,041,800	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	178,671,700	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	284,474,700	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	232,368,400	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	412,935,900	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	637,002,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	309,447,400	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	500,056,500	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	310,940,900	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	550,254,300	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,968,293,100	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	455,485,800	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	378,304,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	683,991,000	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	490,302,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	955,891,200	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	445,309,200	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	665,186,700	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	673,372,900	

第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,740,557,100
第97回利付国債(20年)	900,000,000	993,276,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	483,472,000
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,422,882,900
第100回利付国債(20年)	480,000,000	534,240,000
第101回利付国債(20年)	715,000,000	803,416,900
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,422,325,800
第103回利付国債(20年)	400,000,000	449,300,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	177,936,000
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,317,422,800
第106回利付国債(20年)	380,000,000	426,470,200
第107回利付国債(20年)	760,000,000	851,481,200
第108回利付国債(20年)	870,000,000	964,168,800
第109回利付国債(20年)	520,000,000	578,177,600
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,236,939,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,101,134,300
第112回利付国債(20年)	790,000,000	891,633,500
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,288,134,800
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,646,693,600
第115回利付国債(20年)	700,000,000	800,058,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,707,808,200
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,230,033,600
第118回利付国債(20年)	660,000,000	748,433,400
第119回利付国債(20年)	530,000,000	593,080,600
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,733,358,500
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,695,285,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,055,121,800
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,149,995,100
第124回利付国債(20年)	610,000,000	696,479,700
第125回利付国債(20年)	1,770,000,000	2,056,616,100
第126回利付国債(20年)	730,000,000	836,236,900
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,160,076,600
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,106,692,400
第129回利付国債(20年)	740,000,000	838,035,200
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,459,490,150
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,127,110,000
第132回利付国債(20年)	660,000,000	746,202,600
第133回利付国債(20年)	730,000,000	831,856,900
第134回利付国債(20年)	430,000,000	491,137,400
第135回利付国債(20年)	630,000,000	713,815,200
第136回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,180,084,500
第137回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,203,036,400
第138回利付国債(20年)	620,000,000	692,044,000

第139回利付国債(20年)	830,000,000	934,223,100	
第140回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,749,628,200	
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,817,936,000	
第142回利付国債(20年)	980,000,000	1,123,089,800	
第143回利付国債(20年)	1,920,000,000	2,163,033,600	
第144回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,284,055,500	
第145回利付国債(20年)	2,675,000,000	3,042,705,500	
第146回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,071,628,000	
第147回利付国債(20年)	2,250,000,000	2,535,772,500	
第148回利付国債(20年)	1,800,000,000	2,007,396,000	
第149回利付国債(20年)	2,460,000,000	2,741,866,800	
第150回利付国債(20年)	2,680,000,000	2,953,279,600	
第151回利付国債(20年)	2,445,000,000	2,635,856,700	
第152回利付国債(20年)	2,840,000,000	3,057,061,200	
第153回利付国債(20年)	2,580,000,000	2,804,769,600	
第154回利付国債(20年)	2,745,000,000	2,946,867,300	
第155回利付国債(20年)	2,650,000,000	2,775,424,500	
第156回利付国債(20年)	2,310,000,000	2,237,650,800	
第157回利付国債(20年)	2,950,000,000	2,771,908,500	
第158回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,360,347,000	
第159回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,443,444,800	
第160回利付国債(20年)	1,850,000,000	1,841,582,500	
第161回利付国債(20年)	2,070,000,000	2,025,122,400	
第162回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,228,159,800	
第163回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,350,013,600	
第164回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,200,918,600	
第165回利付国債(20年)	2,150,000,000	2,040,694,000	
第166回利付国債(20年)	1,850,000,000	1,802,399,500	
第167回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,078,328,200	
第168回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,529,673,400	
第169回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,794,164,100	
第170回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,099,143,800	
第171回利付国債(20年)	1,720,000,000	1,536,252,400	
第172回利付国債(20年)	2,370,000,000	2,145,442,500	
第173回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,118,290,000	
第174回利付国債(20年)	2,800,000,000	2,511,180,000	
第175回利付国債(20年)	2,030,000,000	1,847,482,700	
第176回利付国債(20年)	2,740,000,000	2,485,152,600	
第177回利付国債(20年)	2,310,000,000	2,049,177,900	
第178回利付国債(20年)	2,120,000,000	1,909,399,200	
第179回利付国債(20年)	2,935,000,000	2,636,128,950	
第180回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,236,312,400	

	第181回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,627,605,200
	第182回利付国債(20年)	770,000,000	766,873,800
	国債証券合計	515,980,000,000	521,563,440,150
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	99,897,000
	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,982,000
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	80,643,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,534,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	119,991,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	116,777,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	112,436,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	109,909,000
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	221,230,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,096,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,144,000
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	80,890,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	223,848,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	223,262,000
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,626,000
	第726回東京都公募公債	200,000,000	201,542,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	100,683,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,930,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,281,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,090,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	299,001,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	196,940,000
	第830回東京都公募公債	300,000,000	295,035,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,457,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,980,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,383,000
	平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	199,264,000
	第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	247,390,000
	第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,890,000
	第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	224,654,000
	第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,516,000
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,559,000
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,594,000
第78回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	199,790,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	201,602,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	101,103,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,387,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,216,000	

第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,090,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	196,872,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	224,762,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	224,866,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	111,845,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,884,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	152,316,720	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,253,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,255,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,995,320	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,230,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,240,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	99,629,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	156,723,200	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	178,225,320	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	195,798,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	112,889,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	112,273,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,256,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	94,021,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	96,478,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	137,796,780	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	110,533,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	101,188,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	106,309,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,271,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,257,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	454,048,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	100,893,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	94,642,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	296,616,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	103,722,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	86,200,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,851,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,514,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,946,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,136,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,227,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,168,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	306,075,400	

平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	113,118,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,887,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	201,836,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,992,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,927,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,466,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	287,202,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,865,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	84,896,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	196,738,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,454,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	160,672,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	112,235,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	225,072,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,772,833	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,083,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	385,082,100	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	110,324,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	111,773,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	90,706,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	226,386,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	189,840,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	224,654,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	188,474,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	100,816,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,243,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,903,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,464,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,114,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	98,185,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	98,075,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	146,628,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	110,441,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	110,856,000	

平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	104,822,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	113,632,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	105,521,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	115,681,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,785,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	106,634,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,227,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	84,896,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	95,143,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	295,644,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	98,181,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	93,769,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	223,546,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	112,678,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	111,851,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	100,747,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,821,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	101,210,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,903,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,225,600	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	294,876,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,425,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	295,593,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	200,000,000	197,802,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	222,918,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,098,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,728,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,785,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,463,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,044,960	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,962,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,920,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,883,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,750,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,646,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,440,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,033,962	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,292,000	

第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,080,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,997,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,854,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,666,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,392,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,718,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,188,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,448,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,182,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,923,058	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,147,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,514,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,083,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	196,194,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	197,284,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,149,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	99,385,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	225,724,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	79,993,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	283,560,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	97,342,000	
平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	100,884,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	196,454,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	121,564,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	121,859,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	110,976,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	108,623,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,327,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	295,539,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,376,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	130,588,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	223,702,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	113,611,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	111,972,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	80,115,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	80,164,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	105,467,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	337,074,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,167,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,325,000	



	平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,946,000	
	平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,343,000	
	第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	216,570,000	
	令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	295,554,000	
	令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	98,226,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	105,703,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,757,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	111,451,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,142,000	
	第93回川崎市公募公債	100,000,000	98,083,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,784,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,250,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,980,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	112,542,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	110,084,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	201,838,000	
	平成30年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	99,984,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	151,186,500	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,817,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,150,150	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,266,900	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	541,975,500	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	199,704,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	196,584,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	294,561,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	98,674,000	
	平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	100,930,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	201,152,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	99,344,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	110,395,000	
	地方債証券合計	31,711,430,000	32,371,191,103	
特殊債券	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,000,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,935,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,093,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	68,720,000	

第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,187,000	
第21回道路債券	100,000,000	121,861,000	
第27回道路債券	400,000,000	412,680,000	
第28回道路債券	200,000,000	246,332,000	
第33回道路債券	200,000,000	248,770,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,233,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,421,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,814,000	
第42回道路債券	100,000,000	105,001,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,091,000	
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	120,119,000	
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	225,258,000	
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	227,084,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,320,000	
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	117,567,000	
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,788,000	
第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,817,000	
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	114,229,000	
第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,784,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,580,000	
第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,704,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,790,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,846,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,238,000	
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	112,438,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	572,250,000	
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	113,234,000	
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	201,590,000	
	100,000,000	85,277,000	

第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	537,850,300	
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	302,589,000	
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	219,818,000	
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	102,971,040	
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	101,008,000	
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	100,982,000	
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	217,658,000	
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	100,993,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	259,000,000	261,369,850	
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	301,896,000	
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	105,930,000	
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	213,096,000	
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	201,862,000	
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	100,376,000	
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	80,750,000	
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	106,653,320	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,170,150	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,155,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,242,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,071,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	120,219,600	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,670,000	
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	286,335,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	214,297,460	
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	98,563,000	
	100,000,000	98,310,000	

第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	117,495,600	
第2回公営企業債券(30年)	300,000,000	355,947,000	
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	100,000,000	105,240,000	
第5回公営企業債券(30年)	300,000,000	368,184,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	102,897,000	
第7回公営企業債券(30年)	200,000,000	244,782,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	41,186,000	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	120,520,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	224,300,000	
第10回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	220,252,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	600,000,000	599,682,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	200,000,000	154,800,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,870,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	224,632,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	111,533,000	
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	500,000,000	553,815,000	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	705,768,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,846,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,914,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,646,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,882,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,902,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,380,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,730,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,076,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,963,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,856,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,748,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,000,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,291,160	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,797,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,139,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,094,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,200,200	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,060,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	156,240,240	

第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,168,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,992,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,717,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,496,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,711,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,142,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,838,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,196,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,439,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,305,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,960,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,471,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	104,833,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,956,000	
第19回水資源債券(サステナビリティボンド)	200,000,000	199,580,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	112,351,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	114,003,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,953,380	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,139,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,441,400	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	187,256,190	
第54回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,852,600	
第87回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,790,000	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,848,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	205,480,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	129,600,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	71,729,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	151,758,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,416,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,154,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	9,957,000	10,016,642	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,102,000	10,176,047	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	121,410,000	120,381,657	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,937,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	83,418,000	82,655,559	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	109,129,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,067,000	10,134,046	
	10,879,000	11,028,368	

第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券			
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	147,756,000	146,098,177	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,771,000	10,912,315	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	170,145,000	167,924,607	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	60,690,000	60,013,913	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,241,000	11,452,555	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	207,699,000	204,558,591	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	143,102,000	141,084,261	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,325,000	11,553,198	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,346,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,076,000	15,785,627	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,849,000	15,573,334	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,001,000	17,956,116	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,841,000	19,828,456	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,487,000	21,670,533	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,885,000	22,042,446	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,600,000	45,905,568	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,696,000	20,657,164	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,051,000	10,107,989	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,075,000	21,040,005	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,756,000	20,736,292	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,644,000	19,534,437	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,995,000	11,183,564	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,342,000	41,023,083	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,671,000	21,559,646	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,615,000	10,755,542	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,627,000	28,783,189	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,307,000	27,399,529	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,478,000	27,598,284	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,796,000	60,100,904	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,928,000	73,252,310	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,896,000	38,041,251	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,617,000	39,097,605	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,999,000	39,539,099	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,347,000	34,608,183	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,582,000	33,566,953	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,008,000	39,587,232	

第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	170,104,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,967,000	101,988,462	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	133,660,000	137,703,215	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,621,000	39,697,753	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,051,000	41,182,841	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,728,000	41,752,309	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,244,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	129,063,000	132,208,265	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,211,000	45,107,599	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,572,000	94,700,478	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,193,000	52,938,837	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,832,000	56,410,977	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	318,042,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,279,000	56,122,557	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,750,000	174,918,787	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	115,690,000	117,623,179	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,185,000	57,000,244	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,728,000	61,554,508	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,074,000	65,837,826	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,715,000	71,563,194	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,263,000	70,924,689	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,622,000	71,558,087	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,224,000	72,444,896	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,576,000	72,646,735	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,300,000	74,243,541	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,792,000	74,783,966	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,678,000	74,457,313	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,676,000	74,449,292	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,404,000	75,173,895	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,038,000	152,166,696	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,505,000	75,222,776	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,486,000	154,129,320	
	77,841,000	76,501,356	

第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,696,000	152,681,725	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,733,000	77,327,615	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,754,000	155,529,706	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,900,000	156,599,664	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,616,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,463,000	79,213,409	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,231,000	79,154,299	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,487,000	78,721,920	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,746,000	161,332,184	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,277,000	80,947,742	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,445,000	80,260,207	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,474,000	162,722,762	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,090,000	82,061,646	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	256,764,000	246,282,893	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,774,000	165,645,344	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,708,000	85,236,388	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,503,000	85,724,890	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,894,000	176,870,087	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,830,000	89,164,175	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,126,000	178,690,600	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,604,000	179,746,337	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,215,000	89,545,375	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,804,000	181,207,209	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,632,000	181,723,578	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,004,000	91,417,949	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,507,000	92,189,086	



第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	286,005,000	276,006,265	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,920,000	92,664,475	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,243,000	95,212,566	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,107,000	96,070,298	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,081,000	97,208,369	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,006,000	194,723,390	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	91,454,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	79,236,000	
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	599,946,000	
い第823号商工債	200,000,000	200,192,000	
い第829号商工債	200,000,000	200,032,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,754,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,843,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,860,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,828,000	
い第850号商工債	200,000,000	199,624,000	
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	99,982,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,528,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,711,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,603,000	
第385回信金中金債（5年）	100,000,000	99,386,000	
第254号商工債（3年）	300,000,000	299,751,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,103,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	111,730,000	
第53回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,978,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,110,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	196,994,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	490,160,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,126,000	
第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	599,058,000	
第63回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,830,000	
第66回西日本高速道路株式会社社債	800,000,000	799,568,000	
第70回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,823,000	
第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,024,000	
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,699,000	
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	191,802,000	
特殊債券合計	35,984,478,000	36,528,164,013	

社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,673,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	298,254,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,646,000	
	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	98,908,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,760,000	
	第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,916,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,627,000	
	第1回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債	400,000,000	396,220,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,476,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,684,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,870,000	
	第8回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,426,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,908,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,046,000	
	第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,223,000	
	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	100,085,000	
	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	100,104,000	
	第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,988,000	
	第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,710,000	
	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	299,649,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,986,000	
	第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,749,000	
	第10回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	99,260,000	
	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	99,753,000	
	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	199,636,000	
	第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,831,000	
	第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,045,000	
	第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	100,081,000	
	第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,860,000	
	第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,589,000	
	第13回JSR株式会社無担保社債	100,000,000	100,388,000	
	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	99,749,000	

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	198,892,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,996,000	
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,496,000	
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	88,771,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,667,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,051,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	198,978,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	289,581,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,137,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,627,000	
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	98,448,000	
第19回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	87,539,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,710,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,422,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,487,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,999,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,932,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,126,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,708,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	100,393,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,955,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,234,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,861,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	100,125,000	
第14回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	99,838,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,641,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	105,766,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,448,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,675,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,972,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	98,578,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,280,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,922,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,771,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,042,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,685,000	

第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,853,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,811,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,861,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,731,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	196,684,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,868,000	
第8回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	94,875,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,659,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	88,810,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,921,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,817,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	112,439,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	197,548,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,678,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,729,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,208,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	100,217,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	98,527,000	
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	99,861,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	114,238,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	108,829,000	
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	100,000,000	100,739,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,679,000	
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	301,926,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,663,000	
第16回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,728,000	
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	197,822,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,001,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,919,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,803,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	200,002,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,970,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,043,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,059,000	

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	99,378,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,154,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,371,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,060,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,837,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,090,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,016,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,541,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,642,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	198,996,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,704,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,377,000	
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	99,441,000	
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	98,743,000	
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	299,835,000	
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	199,820,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	199,312,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,276,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,228,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	90,172,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	97,272,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,046,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,085,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	97,316,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,516,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,122,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	85,397,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	90,285,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,025,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,927,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	79,877,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	90,623,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,334,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,334,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	223,336,000	

第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,209,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	91,649,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	82,849,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,102,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	81,094,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	88,753,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	73,933,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,910,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,757,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	78,918,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	89,614,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	498,680,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	88,538,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	118,349,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,959,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,411,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	83,959,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	71,661,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	65,048,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	77,262,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	85,672,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	160,212,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,541,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,728,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,605,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,223,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	397,024,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	177,956,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	93,192,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,552,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,806,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,216,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	95,412,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	86,397,000	
第562回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,000,000	

第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,573,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,176,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,127,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,709,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,131,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,600,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,197,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,564,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,074,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,368,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,632,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,356,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,435,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,304,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	127,374,660	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,098,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,350,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,268,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,605,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,482,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,158,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,667,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,102,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,255,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,464,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,328,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,063,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,447,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,231,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,812,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	91,960,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	94,331,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,475,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,528,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,469,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	197,632,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,919,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	297,483,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,153,000	

第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,649,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,468,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	270,717,000	
第55回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,746,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	95,976,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	80,745,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	195,772,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	195,252,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	88,457,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	200,130,000	
社債券合計	28,426,000,000	27,860,862,660	
合計		618,323,657,926	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年11月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	75,237,694
コール・ローン	3,369,019,581
国債証券	296,729,212,650
派生商品評価勘定	12,274,498
未収入金	76,638,434
未収利息	2,007,602,367
前払金	5,627,731
前払費用	133,637,984
差入委託証拠金	453,225,976
流動資産合計	302,862,476,915
資産合計	302,862,476,915
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,344,106



	2022年11月10日現在
項目	金額（円）
未払金	2,057,651
未払解約金	131,147,040
未払利息	7,607
その他未払費用	1
流動負債合計	169,556,405
負債合計	169,556,405
純資産の部	
元本等	
元本	95,557,722,993
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	207,135,197,517
元本等合計	302,692,920,510
純資産合計	302,692,920,510
負債純資産合計	302,862,476,915

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
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11月10日現在
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11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	95,557,722,993口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 3.1676円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (31,676円)</p>

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2022年11月10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	<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	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11月10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。
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つた場合、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ぬ。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありませぬ。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月11日
期首元本額	101,616,434,355円
期中追加設定元本額	11,448,428,381円
期中一部解約元本額	17,507,139,743円
期末元本額	95,557,722,993円

区分	2022年11月10日現在
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,268,497,016円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	550,946,800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）	2,218,215,925円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,444,473円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,373,706,180円
世界経済インデックスファンド	15,440,184,036円
D C マイセレクション 2 5	1,928,369,251円
D C マイセレクション 5 0	1,686,284,282円
D C マイセレクション 7 5	1,170,147,889円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,325,511,010円
D C マイセレクション S 2 5	972,426,994円
D C マイセレクション S 5 0	776,180,091円
D C マイセレクション S 7 5	443,650,284円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	24,934,622円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	92,159,312円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	48,155,531円
D C 世界経済インデックスファンド	13,448,713,618円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	518,574,475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）	21,564,315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）	61,302,826円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	70,160,237円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	64,451,521円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,133,707,551円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	413,017,195円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,659,845,812円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	61,102,806円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	36,200,216円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	407,777,402円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	154,701,486円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	200,521,832円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	697,493,711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）	2,742,941,286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	735,373,450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

区分	2022年11月10日現在
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	597,934,716円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,284,847,817円
コア投資戦略ファンド（切替型）	439,121,979円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	253,828,754円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	109,229,144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）	1,263,103,613円
SMT インデックスバランス・オープン	197,163,689円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	9,946,302,281円
SMT 世界経済インデックス・オープン	284,613,407円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	355,282,153円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	573,071,805円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,774,044円
グローバル経済コア	857,124,866円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	18,016,052円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,820,859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	19,800,250円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	22,923,846円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,055,339円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	13,442,618円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	52,674,406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）	151,128,099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）	11,132,983,848円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	328,770,852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）	272,560,986円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	366,685,928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）	104,963,374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）	52,029,280円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	25,219,685,299
合計	25,219,685,299

(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11月10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	3,329,661,953	-	3,324,034,222	5,627,731
	合計	3,329,661,953	-	3,324,034,222	5,627,731

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2022年11月10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	3,939,675,623	-	3,921,233,746	18,441,877
	アメリカドル	2,124,459,084	-	2,110,038,224	14,420,860
	カナダドル	143,835,719	-	143,826,998	8,721
	ユーロ	1,358,811,229	-	1,359,219,312	408,083
	イギリスポンド	182,377,155	-	179,708,328	2,668,827
	オフショア人民元	130,192,436	-	128,440,884	1,751,552
	合計	3,939,675,623	-	3,921,233,746	18,441,877

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,470,507.80	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,443,314.66	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,091,562.50	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,234,472.64	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,345,312.50	
		T 0.25% 05/31/25	10,900,000.00	9,780,195.36	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,380,195.29	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,405,750.00	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,641,203.11	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,654,785.17	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,180,515.61	
		T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,513,378.92	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,024,687.52	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,578,359.41	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,232,187.52	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,381,059.74	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,594,433.58	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,635,156.25	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,103,582.05	
		T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,197,312.49	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,650,429.68	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,526,406.24	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	3,955,957.02	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,571,046.11	
		T 0.5% 04/30/27	11,940,000.00	10,111,221.12	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	2,954,765.62	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	5,859,721.85	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	3,901,475.76	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,241,113.30	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,402,832.05	
		T 0.625% 05/15/30	12,000,000.00	9,318,750.00	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	6,967,812.48	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,217,371.15	
		T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,708,227.36	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,088,671.87			
T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,500,078.14			

T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,112,109.37	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,308,359.36	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,646,679.68	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,519,062.52	
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,327,220.31	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,051,439.11	
T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,222,299.23	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,054,062.48	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,251,171.86	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,749,265.62	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,312,312.50	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,001,199.29	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	7,865,820.35	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,815,000.00	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,013,842.97	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,057,843.77	
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	8,570,816.45	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,406,267.59	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,829,687.52	
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	4,390,550.82	
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	6,812,500.00	
T 1.25% 06/30/28	4,000,000.00	3,399,687.52	
T 1.25% 08/15/31	13,380,000.00	10,608,876.62	
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,239,472.62	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,195,000.00	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,298,073.81	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,732,343.76	
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	5,200,593.75	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	2,987,325.01	
T 1.375% 11/15/31	21,030,000.00	16,741,851.56	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,686,250.00	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,151,218.75	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,345,390.64	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,414,581.25	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,748,535.17	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,017,558.61	
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,263,750.00	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,401,367.22	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,118,750.00	
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,064,724.60	
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,192,652.39	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,750,156.25	



T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,425,927.72
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,520,875.00
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,892,570.34
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,297,892.21
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,182,968.78
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	1,969,570.32
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,287,500.00
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,028,471.89
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,574,375.00
T 1.875% 02/15/32	8,020,000.00	6,651,587.50
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,312,132.85
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,985,781.25
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,617,812.52
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,743,173.43
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,706,093.78
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	5,584,359.37
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,848,554.67
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,429,687.52
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	4,929,667.95
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,138,687.50
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	3,987,601.15
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,329,859.38
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,594,031.23
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,774,804.70
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,607,503.90
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,881,953.12
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,222,462.91
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,842,703.12
T 2.25% 03/31/24	5,900,000.00	5,701,105.45
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	6,990,234.37
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,749,121.12
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,621,928.12
T 2.25% 08/15/27	11,530,000.00	10,521,575.36
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	2,807,300.00
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,685,859.37
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,021,175.79
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,688,888.64
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,122,593.77
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	6,953,132.81
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,376,250.00
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,141,601.57
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	3,983,632.84
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,586,750.02

T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,389,519.51	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,429,578.13	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,763,932.81	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,165,821.13	
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,568,105.49	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,801,562.50	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,826,117.20	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,376,879.28	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,778,906.25	
T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,220,646.10	
T 2.5% 02/15/46	3,950,000.00	2,798,945.30	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,636,152.32	
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,024,855.47	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,430,767.56	
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,147,737.50	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,943,007.81	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,419,609.37	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,507,402.32	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,925,000.00	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,078,195.31	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,218,171.87	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,262,382.84	
T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	6,674,531.25	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,005,226.56	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,580,605.48	
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,274,279.69	
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	2,996,350.00	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,262,957.04	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,843,750.00	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	6,760,591.42	
T 2.875% 05/15/32	8,500,000.00	7,677,890.62	
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,226,949.23	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	4,278,021.12	
T 2.875% 05/15/52	4,800,000.00	3,667,125.02	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,666,304.70	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,232,642.21	
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,640,087.50	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,755,187.50	
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	1,903,515.62	
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	3,943,447.26	
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	7,993,047.67	
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,139,843.75	

T 2% 04/30/24	6,230,000.00	5,984,207.06
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,173,139.24
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,263,886.70
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,442,150.00
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,874,359.37
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,330,939.81
T 2% 11/15/41	8,200,000.00	5,542,046.91
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	865,593.75
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,625,625.00
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	4,746,779.68
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,476,887.50
T 3.125% 08/31/29	4,050,000.00	3,791,179.68
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,890,750.00
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,442,656.25
T 3.25% 05/15/42	1,750,000.00	1,467,539.06
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,525,107.81
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,466,078.12
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	695,165.62
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,101,687.51
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,759,687.50
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	1,819,375.00
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,686,875.00
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,353,031.25
T 3% 02/15/47	800,000.00	622,875.00
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	3,469,609.37
T 3% 02/15/49	5,000,000.00	3,935,937.50
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,303,214.07
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	1,955,078.12
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,499,536.73
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,545,664.06
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,090,937.50
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,031,015.64
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,793,750.00
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,195,375.00
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	890,789.06
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,303,367.18
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,011,718.75
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,899,554.69
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	1,939,640.62
T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	2,966,937.50
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,130,449.22
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	563,707.03
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,734,265.62

	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,426,251.56	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	783,691.41	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,189,546.87	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,362,968.75	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,114,074.22	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,777,761.72	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,566,679.68	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,187,156.25	
	アメリカドル 小計	1,203,100,000.00	1,037,911,231.19 (151,960,583,358)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,029,177.20	
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,276,376.00	
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,253,873.60	
	CAN 0.5% 12/01/30	3,360,000.00	2,676,340.80	
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,247,116.00	
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	658,322.00	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,352,563.20	
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,695,559.00	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,180,000.00	2,726,563.80	
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,376,225.20	
	CAN 1.5% 05/01/24	1,590,000.00	1,530,184.20	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,259,577.60	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,408,880.20	
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,147,056.00	
	CAN 1.5% 12/01/31	4,320,000.00	3,682,454.40	
	CAN 1.75% 12/01/53	2,520,000.00	1,701,176.40	
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	723,897.00	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,382,232.60	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,244,455.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,227,814.40	
	CAN 2.25% 06/01/29	760,000.00	708,342.80	
	CAN 2.25% 12/01/29	510,000.00	473,545.20	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,298,106.60	
	CAN 2.5% 12/01/32	500,000.00	462,105.00	
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	821,074.80	
	CAN 2.75% 09/01/27	760,000.00	731,849.60	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	915,075.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	640,619.20	
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	380,016.70	
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,143,894.60	
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,436,321.80	
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,155,719.60	

	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,041,621.00
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,115,633.60
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,110,490.50
	CAN 5.75% 06/01/29	1,020,000.00	1,157,567.40
	CAN 5.75% 06/01/33	1,120,000.00	1,343,596.80
	CAN 5% 06/01/37	880,000.00	1,022,586.40
	カナダドル 小計	63,820,000.00	57,558,011.20 (6,227,776,811)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,718,264.00
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,518,132.80
	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,704,625.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	40,269,812.10
	MBONO 5% 03/06/25	5,200,000.00	4,659,356.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	35,975,407.80
	MBONO 7.75% 05/29/31	46,470,000.00	41,466,110.40
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	23,445,036.70
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,654,453.50
	MBONO 8.5% 05/31/29	24,390,000.00	23,096,110.50
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	23,850,180.90
	MBONO 8% 07/31/53	3,700,000.00	3,061,343.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,222,875.40
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	23,677,648.00
	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,310,691.60
	メキシコペソ 小計	371,680,000.00	338,630,047.70 (2,535,289,304)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,040,000.00	867,672.00
	BGB 0.35% 06/22/32	1,910,000.00	1,526,777.60
	BGB 0.4% 06/22/40	1,010,000.00	646,097.00
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,376,221.40
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	292,198.40
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,587,298.80
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,578,037.50
	BGB 0.8% 06/22/28	1,460,000.00	1,339,199.60
	BGB 0.9% 06/22/29	2,140,000.00	1,934,303.20
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	694,114.20
	BGB 0% 10/22/31	1,180,000.00	934,642.60
	BGB 1.25% 04/22/33	740,000.00	643,363.40
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	711,658.50
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	652,528.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	929,057.60
	BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	974,155.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	904,449.00
BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,397,395.20	

BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,823,711.40
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	729,828.00
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	655,847.50
BGB 2.6% 06/22/24	1,730,000.00	1,742,248.40
BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	384,028.00
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	1,022,841.90
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,040,289.70
BGB 4.25% 03/28/41	1,730,000.00	2,006,263.70
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,224,736.20
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,194,361.20
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,225,800.80
BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	2,772,274.00
BKO 0.2% 06/14/24	500,000.00	485,335.00
BKO 0.4% 09/13/24	1,300,000.00	1,260,519.00
BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,799,180.50
BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,837,737.60
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,403,875.20
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	548,210.20
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,689,534.00
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,749,235.30
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	1,910,571.60
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,362,921.60
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,030,985.00
BTPS 0.9% 04/01/31	3,830,000.00	2,985,829.70
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	661,980.00
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	1,917,778.50
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,786,207.70
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,322,017.40
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,634,574.80
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	968,920.00
BTPS 0% 01/30/24	1,630,000.00	1,578,019.30
BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,451,264.60
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,886,870.00
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,280,720.00
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,429,095.00
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,736,382.00
BTPS 1.1% 04/01/27	1,000,000.00	904,410.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,796,983.50
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,625,118.60
BTPS 1.45% 03/01/36	700,000.00	501,452.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,212,002.00
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,340,264.00
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	750,850.00

BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,318,275.40	
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,671,406.80	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,707,804.00	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,136,343.20	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	995,080.80	
BTPS 1.75% 05/30/24	1,910,000.00	1,878,122.10	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	984,000.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	1,360,000.00	922,080.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,417,611.00	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,613,384.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,570,640.60	
BTPS 2.1% 07/15/26	900,000.00	862,767.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	354,206.50	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	657,359.40	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,162,808.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,850,000.00	2,248,194.00	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,219,395.20	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,270,819.10	
BTPS 2.5% 11/15/25	1,250,000.00	1,227,550.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,930,323.50	
BTPS 2.5% 12/01/32	1,250,000.00	1,074,312.50	
BTPS 2.65% 12/01/27	960,000.00	914,812.80	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,710,000.00	1,306,593.90	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	806,277.60	
BTPS 2.8% 06/15/29	1,820,000.00	1,708,561.40	
BTPS 2.8% 12/01/28	2,020,000.00	1,925,989.20	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	985,229.20	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,089,957.60	
BTPS 2% 12/01/25	1,490,000.00	1,439,906.20	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,194,731.20	
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	833,750.40	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,970,000.00	1,659,508.30	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,638,618.80	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	1,840,350.80	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	3,878,067.60	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,186,636.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,260,000.00	1,160,787.60	
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,069,832.80	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,812,700.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,163,678.40	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,778,595.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,197,209.00	

BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,429,939.00
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,202,380.00
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	3,893,999.20
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,560,713.60
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,826,676.40
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,152,922.30
BTPS 5% 09/01/40	2,850,000.00	3,043,116.00
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,097,988.00
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,307,021.40
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,609,748.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	848,808.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,611,903.90
DBR 0.25% 02/15/29	2,410,000.00	2,156,227.00
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,374,022.10
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,974,879.60
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,857,350.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,860,000.00	2,639,293.80
DBR 0.5% 08/15/27	2,930,000.00	2,729,793.10
DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,125,805.50
DBR 0% 02/15/31	2,030,000.00	1,710,173.50
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	3,006,836.40
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,798,304.20
DBR 0% 05/15/36	2,730,000.00	2,016,459.90
DBR 0% 08/15/26	2,350,000.00	2,180,165.50
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,045,035.00
DBR 0% 08/15/30	3,830,000.00	3,261,589.70
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	570,960.60
DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,641,302.50
DBR 0% 08/15/50	4,580,000.00	2,576,753.80
DBR 0% 08/15/52	1,790,000.00	969,231.30
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,674,656.00
DBR 0% 11/15/28	1,720,000.00	1,521,959.20
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	2,957,939.20
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,271,382.30
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	3,031,451.20
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,642,987.50
DBR 1.8% 08/15/53	850,000.00	781,498.50
DBR 1% 05/15/38	800,000.00	665,720.00
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	1,964,000.00
DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,539,681.60
DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	3,530,688.00
DBR 2.5% 08/15/46	3,210,000.00	3,401,540.70
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,580,712.10



DBR 4.0% 01/04/37	3,190,000.00	3,852,626.80
DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	2,718,051.50
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	2,902,537.50
DBR 4.75% 07/04/34	2,530,000.00	3,188,989.10
DBR 4.75% 07/04/40	2,030,000.00	2,742,306.70
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,551,704.00
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,754,568.40
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,381,357.80
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,590,775.00
DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,238,478.40
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,308,969.60
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,346,052.40
FRTR 0.5% 05/25/26	3,550,000.00	3,332,527.00
FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,501,754.00
FRTR 0.5% 05/25/40	3,210,000.00	2,131,921.50
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	418,720.50
FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,216,551.60
FRTR 0.75% 02/25/28	2,150,000.00	1,975,097.50
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	5,759,753.00
FRTR 0.75% 05/25/52	2,780,000.00	1,606,728.80
FRTR 0.75% 05/25/53	2,660,000.00	1,507,661.40
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,313,613.50
FRTR 0% 02/25/24	2,850,000.00	2,769,345.00
FRTR 0% 02/25/25	4,000,000.00	3,793,840.00
FRTR 0% 02/25/26	4,460,000.00	4,137,720.40
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,127,347.20
FRTR 0% 03/25/24	4,260,000.00	4,131,944.40
FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,537,040.10
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,564,533.60
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,443,805.80
FRTR 0% 11/25/30	6,630,000.00	5,441,771.40
FRTR 0% 11/25/31	4,770,000.00	3,797,683.20
FRTR 1.25% 05/25/34	4,390,000.00	3,710,471.90
FRTR 1.25% 05/25/36	4,750,000.00	3,874,195.00
FRTR 1.5% 05/25/31	6,170,000.00	5,722,304.80
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	2,621,956.50
FRTR 1.75% 05/25/66	1,380,000.00	1,015,155.60
FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,484,452.80
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,118,150.40
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,384,345.50
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,083,478.40
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,099,385.00

FRTR 2.5% 05/25/30	4,980,000.00	5,013,266.40
FRTR 2.5% 05/25/43	520,000.00	478,202.40
FRTR 2.75% 10/25/27	5,580,000.00	5,687,470.80
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	2,937,605.20
FRTR 2% 11/25/32	2,670,000.00	2,511,161.70
FRTR 3.25% 05/25/45	3,230,000.00	3,359,619.90
FRTR 3.5% 04/25/26	5,600,000.00	5,822,936.00
FRTR 4.5% 04/25/41	3,920,000.00	4,733,870.40
FRTR 4.75% 04/25/35	2,940,000.00	3,500,217.00
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	2,918,495.80
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,481,370.50
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	3,792,429.50
FRTR 5.5% 04/25/29	6,520,000.00	7,688,384.00
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,502,772.80
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,101,647.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	846,718.50
IRISH 0.2% 10/18/30	960,000.00	804,374.40
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	376,568.70
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	454,639.10
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	327,120.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	710,817.80
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	676,557.50
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,104,600.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	583,925.10
IRISH 1.35% 03/18/31	790,000.00	726,349.70
IRISH 1.5% 05/15/50	880,000.00	642,496.80
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	496,700.40
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	959,850.00
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,205,619.80
IRISH 2% 02/18/45	1,100,000.00	926,706.00
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	984,608.20
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,242,232.40
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,197,918.80
NETHER 0.25% 07/15/29	750,000.00	655,477.50
NETHER 0.5% 01/15/40	1,780,000.00	1,283,397.80
NETHER 0.5% 07/15/26	1,420,000.00	1,337,256.60
NETHER 0.5% 07/15/32	1,220,000.00	1,017,907.00
NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,459,832.40
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,564,986.00
NETHER 0% 01/15/24	1,630,000.00	1,590,928.90
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,109,960.60
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,680,748.00
NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,205,755.50

NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	656,544.00	
NETHER 0% 01/15/52	1,410,000.00	729,068.70	
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,132,447.50	
NETHER 0% 07/15/31	1,490,000.00	1,221,531.80	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,630,000.00	1,637,090.50	
NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,472,363.00	
NETHER 2% 01/15/54	480,000.00	440,731.20	
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	1,987,094.60	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,870,000.00	2,214,622.30	
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,555,810.20	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,002,371.20	
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,233,862.90	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,867,932.60	
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,190,112.50	
OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,004,080.00	
OBL 0% 10/09/26	3,900,000.00	3,597,906.00	
OBL 0% 10/10/25	5,000,000.00	4,716,050.00	
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,314,756.80	
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,420,709.00	
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	419,532.00	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,240,673.10	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,000,925.20	
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	131,821.20	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,106,666.00	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	470,051.40	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	1,954,950.40	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	155,406.90	
RAGB 0.9% 02/20/32	1,250,000.00	1,058,112.50	
RAGB 0% 02/20/30	1,210,000.00	999,653.60	
RAGB 0% 02/20/31	1,430,000.00	1,143,899.90	
RAGB 0% 04/20/25	960,000.00	908,889.60	
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,390,291.20	
RAGB 0% 10/20/28	450,000.00	386,631.00	
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	397,035.30	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,037,332.90	
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	709,952.70	
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	171,747.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	981,297.90	
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	377,586.40	
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	630,722.70	
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	694,441.70	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	865,723.20	

RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	509,027.40
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,076,583.60
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,482,600.30
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,377,414.00
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	305,267.60
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	225,869.20
RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	432,561.60
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	315,690.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	583,829.20
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	311,194.10
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	790,830.00
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	577,895.50
RFGB 0.5% 09/15/29	550,000.00	475,975.50
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	685,496.00
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	423,222.80
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	404,061.00
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	273,645.00
RFGB 0% 09/15/30	520,000.00	423,342.40
RFGB 1.125% 04/15/34	530,000.00	440,244.50
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	334,057.50
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	372,983.10
RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	436,256.80
RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	496,912.00
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	555,604.50
RFGB 2% 04/15/24	510,000.00	509,841.90
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	868,005.70
SPGB 0.1% 04/30/31	2,700,000.00	2,119,851.00
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,212,483.50
SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	2,859,774.00
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,059,829.30
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,049,248.80
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,768,250.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,240,652.00
SPGB 0.8% 07/30/29	1,130,000.00	986,083.20
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,019,839.20
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,166,182.40
SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,510,750.40
SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,396,761.60
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,673,734.60
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,035,643.60
SPGB 0% 05/31/25	1,670,000.00	1,569,332.40
SPGB 1.2% 10/31/40	2,810,000.00	1,945,700.20
SPGB 1.25% 10/31/30	1,950,000.00	1,715,571.00

SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,057,985.00	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	2,021,506.90	
SPGB 1.4% 07/30/28	3,030,000.00	2,811,930.90	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,474,961.40	
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	2,866,568.00	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	334,006.20	
SPGB 1.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,907,480.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	2,995,374.50	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,000,000.00	1,696,660.00	
SPGB 1.9% 10/31/52	1,190,000.00	817,565.70	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,258,485.00	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,740,000.00	2,555,241.80	
SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	580,573.70	
SPGB 1% 10/31/50	2,330,000.00	1,292,194.70	
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,791,594.50	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,150,000.00	1,988,019.00	
SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,870,011.00	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,760,000.00	1,510,080.00	
SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,361,448.00	
SPGB 2.9% 10/31/46	1,800,000.00	1,630,926.00	
SPGB 3.45% 07/30/43	570,000.00	557,043.90	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,700,736.60	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,572,441.20	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	2,769,742.80	
SPGB 4.4% 10/31/23	2,590,000.00	2,641,618.70	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,010,201.20	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,590,000.00	1,862,557.80	
SPGB 4.8% 01/31/24	1,840,000.00	1,894,390.40	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,030,000.00	2,423,495.20	
SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	3,932,078.30	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,179,106.40	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,510,163.80	
SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,311,361.20	
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,246,297.50	
ユーロ 小計	725,840,000.00	678,241,686.60 (99,470,925,756)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,140,363.00
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,176,943.00
	UKT 0.125% 01/31/28	1,460,000.00	1,229,582.80
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,763,396.80
	UKT 0.25% 07/31/31	2,370,000.00	1,799,967.60
	UKT 0.375% 10/22/26	2,970,000.00	2,641,013.10

UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,696,737.00
UKT 0.5% 01/31/29	1,930,000.00	1,606,551.30
UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	539,886.00
UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,591,795.00
UKT 0.625% 07/31/35	1,910,000.00	1,322,522.20
UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	519,581.30
UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	660,804.30
UKT 0.875% 07/31/33	1,260,000.00	958,532.40
UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,434,324.00
UKT 1.125% 01/31/39	1,120,000.00	763,985.60
UKT 1.125% 10/22/73	870,000.00	438,340.80
UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	860,833.00
UKT 1.25% 07/31/51	1,710,000.00	1,002,966.30
UKT 1.25% 10/22/41	2,460,000.00	1,635,285.00
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,499,856.00
UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,542,751.50
UKT 1.5% 07/31/53	1,070,000.00	666,128.50
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	967,504.70
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	863,214.60
UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	929,380.80
UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	892,372.00
UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	1,487,175.30
UKT 1.75% 09/07/37	2,190,000.00	1,696,417.80
UKT 1% 01/31/32	3,600,000.00	2,890,764.00
UKT 1% 04/22/24	1,800,000.00	1,744,920.00
UKT 2.5% 07/22/65	1,820,000.00	1,498,569.80
UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,674,080.20
UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,723,235.80
UKT 3.25% 01/22/44	2,010,000.00	1,869,380.40
UKT 3.5% 01/22/45	2,120,000.00	2,048,958.80
UKT 3.5% 07/22/68	1,830,000.00	1,929,423.90
UKT 3.75% 07/22/52	1,100,000.00	1,136,278.00
UKT 4.125% 01/29/27	740,000.00	755,643.60
UKT 4.25% 03/07/36	1,940,000.00	2,056,555.20
UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,236,311.00
UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	1,712,988.00
UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,415,347.00
UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	1,855,437.50
UKT 4.25% 12/07/46	1,320,000.00	1,429,916.40
UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,662,706.30
UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,191,858.70
UKT 4.5% 09/07/34	1,570,000.00	1,707,170.90
UKT 4.5% 12/07/42	2,050,000.00	2,266,746.50

	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,600,072.40	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	1,847,373.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,421,075.00	
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,224,981.60	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,413,737.50	
イギリスポンド 小計		92,710,000.00	81,641,743.20 (13,590,900,990)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,455,633.40	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,933,925.50	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	6,847,167.60	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,398,250.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,640,000.00	9,161,856.00	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,571,161.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	6,360,000.00	6,374,628.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	4,440,000.00	5,354,107.20	
スウェーデンクローナ 小計		58,910,000.00	57,096,728.70 (769,092,935)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,340,000.00	3,625,679.40	
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,582,455.20	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,820,000.00	4,528,245.40	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,945,701.70	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,570,000.00	6,316,069.50	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,817,860.00	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	3,010,358.40	
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,663,680.40	
	NGB 3% 03/14/24	7,530,000.00	7,483,464.60	
ノルウェークローネ 小計		46,600,000.00	42,973,514.60 (605,926,555)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,210,000.00	3,503,185.20	
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,273,504.00	
	DGB 0.5% 11/15/29	8,280,000.00	7,287,890.40	
	DGB 0% 11/15/24	3,840,000.00	3,672,768.00	
	DGB 0% 11/15/31	6,960,000.00	5,602,312.80	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,511,948.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,430,545.80	
	DGB 4.5% 11/15/39	12,270,000.00	15,615,783.60	
デンマーククローネ 小計		57,470,000.00	54,897,937.80 (1,082,587,333)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,290,000.00	1,711,889.50	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,025,430.40	
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,898,964.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,604,125.00	

	POLGB 1.75% 04/25/32	2,650,000.00	1,622,727.50	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,554,409.90	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,130,000.00	2,921,792.40	
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,650,000.00	6,344,527.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,260,000.00	3,383,760.60	
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,910,000.00	3,066,573.90	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,605,412.40	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,180,000.00	2,846,831.40	
	POLGB 3.75% 05/25/27	1,390,000.00	1,175,689.80	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	541,326.00	
	<b>ポーランドズロチ 小計</b>	<b>49,080,000.00</b>	<b>39,303,460.30</b>	<b>(1,222,738,510)</b>
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,230,000.00	2,099,165.90	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,914,003.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,810,000.00	2,513,910.30	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,181,916.80	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,170,000.00	1,807,436.40	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,171,992.40	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,400,000.00	1,986,912.00	
	ACGB 1% 11/21/31	3,610,000.00	2,840,817.30	
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,906,832.80	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,382,482.80	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,760,000.00	2,540,607.60	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,371,526.80	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,319,827.30	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,053,528.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,861,272.70	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,582,776.80	
	ACGB 2.75% 11/21/29	2,070,000.00	1,951,326.90	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,557,260.80	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,150,654.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	996,038.40	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,150,000.00	1,107,496.00	
	ACGB 3% 03/21/47	1,360,000.00	1,105,557.60	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,696,498.40	
ACGB 4.25% 04/21/26	2,130,000.00	2,188,851.90		
ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,440,907.70		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,440,756.00		
	<b>オーストラリアドル 小計</b>	<b>53,490,000.00</b>	<b>48,170,356.60</b>	<b>(4,534,275,666)</b>
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	590,000.00	468,896.60	
	NZGB 0.5% 05/15/24	930,000.00	874,925.40	
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	582,310.40	



	NZGB 1.5% 05/15/31	720,000.00	568,699.20
	NZGB 1.75% 05/15/41	470,000.00	292,419.90
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	814,385.00
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	499,848.30
	NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	354,380.00
	NZGB 2% 05/15/32	580,000.00	468,239.80
	NZGB 3.5% 04/14/33	540,000.00	493,813.80
	NZGB 3% 04/20/29	830,000.00	761,392.20
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	839,059.20
	ニュージーランドドル 小計	8,170,000.00	7,018,369.80 (604,843,109)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	693,930.00
	SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	750,716.10
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	560,423.50
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	580,895.70
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	242,828.80
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,041,314.40
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	768,363.70
	SIGB 2.375% 06/01/25	940,000.00	923,239.80
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	368,703.50
	SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	586,685.80
	SIGB 2.625% 08/01/32	350,000.00	325,216.50
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	695,757.20
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	573,400.80
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	626,970.50
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	603,823.50
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	669,065.60
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	820,695.70
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	746,082.80
	SIGB 3% 08/01/72	280,000.00	270,127.20
	SIGB 3% 09/01/24	1,210,000.00	1,206,079.60
	シンガポールドル 小計	14,010,000.00	13,054,320.70 (1,363,654,340)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,800,000.00	1,564,416.00
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,917,715.20
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,463,023.90
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	660,136.70
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,498,621.40
	MGS 3.757% 05/22/40	1,830,000.00	1,578,997.20
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,631,444.40
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,558,794.70
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,368,342.30
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,085,955.20

	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,114,564.20	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,938,322.40	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,098,291.20	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	595,068.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,119,313.60	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,289,408.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,007,509.40	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,291,520.00	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,429,244.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,665,002.50	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,521,950.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	580,000.00	579,124.20	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,761,681.00	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,023,813.00	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,423,271.60	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,297,510.40	
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	1,839,190.40	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,648,332.00	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,021,172.90	
	マレーシアリングット 小計	50,650,000.00	48,991,735.80 (1,524,064,312)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,010,000.00	955,440.20	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,030,522.47	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,258,607.29	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	950,000.00	795,658.04	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,970,000.00	1,538,848.55	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,195,082.43	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,187,642.11	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,400,782.39	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	1,892,862.42	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,600,279.00	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	3,030,000.00	3,050,835.18	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,758,862.48	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,723,750.70	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,482,331.71	
	イスラエルシェケル 小計	27,720,000.00	26,871,504.97 (1,106,788,921)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	76,520,000.00	76,064,706.00	
	CGB 2.18% 06/25/24	22,500,000.00	22,547,025.00	
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,738,412.00	
	CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,708,984.00	
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,002,000.00	

	CGB 2.68% 05/21/30	15,030,000.00	14,981,753.70	
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,415,675.60	
	CGB 2.75% 02/17/32	23,500,000.00	23,488,955.00	
	CGB 2.75% 06/15/29	25,700,000.00	25,796,118.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	19,750,000.00	19,903,062.50	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,798,071.50	
	CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	29,998,936.40	
	CGB 2.89% 11/18/31	18,510,000.00	18,730,824.30	
	CGB 2.91% 10/14/28	10,720,000.00	10,901,060.80	
	CGB 3.01% 05/13/28	10,930,000.00	11,188,166.60	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,194,509.40	
	CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	47,865,406.40	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,165,442.50	
	CGB 3.28% 12/03/27	19,110,000.00	19,858,538.70	
	CGB 3.39% 03/16/50	10,420,000.00	10,805,748.40	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	7,962,932.50	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,390,000.00	8,125,231.10	
	CGB 3.81% 09/14/50	8,860,000.00	9,884,570.40	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,430,418.60	
	CGB 4.08% 10/22/48	9,060,000.00	10,508,331.60	
	オフショア人民元 小計	493,330,000.00	503,064,881.00 (10,129,764,750)	
	合計		296,729,212,650 (296,729,212,650)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 214銘柄	100.0%	51.2%
カナダドル	国債証券 38銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 350銘柄	100.0%	33.5%
イギリスポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	4.6%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.5%

ニュージーランドドル	国債証券	12銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券	20銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングット	国債証券	29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券	25銘柄	100.0%	3.4%

(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

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11月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	976,142,582
コール・ローン	241,418,124
国債証券	85,562,061,713
未収利息	1,353,239,033
前払費用	108,004,198
流動資産合計	88,240,865,650
資産合計	88,240,865,650
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	66,448,348
未払利息	545
流動負債合計	66,448,893
負債合計	66,448,893
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	47,663,305,590
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	40,511,111,167
元本等合計	88,174,416,757
純資産合計	88,174,416,757
負債純資産合計	88,240,865,650

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2022年11月10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取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取場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2022年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,663,305,590口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1.8499円
の額	(1万円当たり純資産額) (18,499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11月10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11月10日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年11月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

### （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月11日
期首元本額	46,889,081,206円
期中追加設定元本額	4,290,663,589円
期中一部解約元本額	3,516,439,205円
期末元本額	47,663,305,590円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国債券インデックス・オープン	5,205,574,648円
世界経済インデックスファンド	13,623,240,711円
D C 新興国債券インデックス・オープン	5,247,443,705円
D C 世界経済インデックスファンド	11,511,812,974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）	3,982,340円
コア投資戦略ファンド（安定型）	35,878,977円
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（S M A 専用）	43,180,163円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	500,045,638円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,668,677,646円
コア投資戦略ファンド（切替型）	81,053,946円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	210,199,620円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	94,217,538円
S M T インデックスバランス・オープン	168,796,465円
外国債券S M T B セレクション（S M A 専用）	1,942,180,440円
S M T 世界経済インデックス・オープン	372,459,099円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	464,021,590円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	748,141,408円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	10,291,954円
グローバル経済コア	748,562,508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
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	34,524,277円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	27,692,488円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,220,880円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	11,990,059円
M y S M T 新興国債券インデックス（ノーロード）	6,301,210円
10資産分散投資ファンド	13,984円

区分	2022年11月10日現在
F O F s用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	30,592,816円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	491,248,452円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	136,997,450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）	9,921,305円
S M T A M海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	258,840,573円
S M T A M海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	274,886,771円
S M T A M海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	273,471,389円
S M T A M海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	250,720,521円
S M T A M海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	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11月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	6,787,355,318
合計	6,787,355,318

(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	32,425,824.00	
		MBONO 10% 12/05/24	104,250,000.00	104,107,177.50	
		MBONO 5.5% 03/04/27	46,000,000.00	39,393,020.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	155,731,261.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000.00	105,402,120.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	158,100,000.00	141,075,792.00	



	MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	69,245,215.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	13,600,000.00	11,762,776.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	115,100,000.00	108,993,945.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	87,906,741.00	
	MBONO 8% 07/31/53	12,000,000.00	9,928,680.00	
	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	123,754,488.00	
	MBONO 8% 11/07/47	100,600,000.00	83,872,232.00	
	MBONO 8% 12/07/23	88,000,000.00	85,701,440.00	
メキシコペソ 小計		1,269,950,000.00	1,159,300,711.50	(8,679,568,496)
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	104,100,000.00	90,606,422.66	
	BLTN 0% 01/01/26	24,500,000.00	17,127,656.00	
	BLTN 0% 07/01/23	53,300,000.00	49,141,651.26	
	BLTN 0% 07/01/24	13,850,000.00	11,446,090.12	
	BLTN 0% 07/01/25	38,900,000.00	28,853,693.78	
	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	30,632,225.48	
	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000.00	38,668,323.07	
	BNTNF 10% 01/01/29	26,700,000.00	24,291,957.19	
	BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	12,352,243.42	
	BNTNF 10% 01/01/33	1,500,000.00	1,310,148.03	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,317,750.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,800,250.00	
ブラジルレアル 小計		353,000,000.00	307,548,411.01	(8,656,903,427)
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	805,000,000.00	659,189,908.86	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,726,903,407.80	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,920,000,000.00	1,814,322,936.96	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,160,000,000.00	1,997,711,210.16	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	2,051,390,419.39	
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	628,115,761.68	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,790,000,000.00	1,825,426,552.30	
チリペソ 小計		12,530,000,000.00	11,703,060,197.15	(1,888,370,684)
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	55,708,736,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	18,000,000,000.00	14,892,480,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	40,100,000,000.00	25,043,653,000.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	25,400,000,000.00	13,602,462,000.00	
コロンビアペソ 小計		148,800,000,000.00	109,247,331,000.00	(3,263,982,508)
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,432,330.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	5,204,396.50	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,638,506.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	9,500,000.00	8,832,530.00	

	PERUGB 6.15% 08/12/32	8,300,000.00	7,438,709.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,350,000.00	7,993,455.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	8,250,000.00	7,558,320.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	8,350,000.00	8,016,584.50	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,550,000.00	6,848,025.00	
	ペルーソル 小計	63,850,000.00	58,962,856.00	(2,206,507,997)
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	21,117,750.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	15,240,160.00	
	ウルグアイペソ 小計	42,000,000.00	36,357,910.00	(132,510,038)
ドミニカペ ソ	DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	31,548,660.00	
	ドミニカペソ 小計	33,000,000.00	31,548,660.00	(84,973,160)
チェココ ルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	17,965,674.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	55,150,324.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	44,335,100.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	68,900,000.00	50,179,870.00	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	21,331,440.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	57,000,000.00	41,226,960.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	52,834,860.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	13,046,825.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	51,500,000.00	37,787,095.00	
	CZGB 1% 06/26/26	62,800,000.00	53,188,460.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	62,700,000.00	57,108,414.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	63,300,000.00	53,763,855.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	80,500,000.00	68,150,495.00	
	CZGB 2% 10/13/33	64,500,000.00	46,930,200.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	18,395,740.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	30,796,425.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28	33,000,000.00	32,835,330.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	45,030,952.00	
	CZGB 5% 09/30/30	20,000,000.00	19,373,000.00	
	CZGB 6% 02/26/26	39,500,000.00	39,744,900.00	
	チェココルナ 小計	952,900,000.00	799,175,919.00	(4,819,590,214)
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	444,028,860.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	222,500,000.00	206,484,450.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	363,480,240.00	
	HGB 1% 11/26/25	635,000,000.00	475,913,450.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	712,000,000.00	378,136,080.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	130,662,400.00	

	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	457,804,680.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	580,500,000.00	422,145,405.00	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	253,148,480.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	509,018,440.00	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	172,856,320.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	349,225,100.00	
	HGB 3% 08/21/30	615,000,000.00	392,240,850.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	420,639,680.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	188,176,000.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	300,000,000.00	224,856,000.00	
	HGB 4.75% 11/24/32	300,000,000.00	205,638,000.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	564,511,200.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	476,000,000.00	446,340,440.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	572,000,000.00	481,481,000.00	
	ハンガリーフォリント 小計	9,962,000,000.00	7,086,787,075.00 (2,586,698,542)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	13,829,675.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	12,152,712.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	18,700,000.00	11,734,250.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	17,400,000.00	10,654,890.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	16,234,518.50	
	POLGB 2.5% 04/25/24	19,800,000.00	18,482,904.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	19,987,335.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	13,979,856.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	20,600,000.00	16,156,374.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	19,324,962.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	25,350,000.00	22,694,080.50	
	POLGB 3.75% 05/25/27	14,700,000.00	12,433,554.00	
	POLGB 4% 10/25/23	12,700,000.00	12,328,779.00	
		ポーランドズロチ 小計	247,800,000.00	199,993,890.00 (6,221,849,916)
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,259,510.00	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	1,200,000.00	1,120,476.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	8,000,000.00	6,656,720.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	12,600,000.00	11,087,244.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	6,000,000.00	4,138,500.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,123,700.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	10,500,000.00	8,499,435.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	6,400,000.00	4,722,560.00	
	ROMGB 4.25% 06/28/23	5,100,000.00	4,987,851.00	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,075,854.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	3,200,000.00	2,939,648.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	4,500,000.00	3,141,135.00	

	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,159,171.00	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	2,800,000.00	2,250,080.00	
	ROMGB 4% 10/25/23	14,900,000.00	14,381,629.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	10,100,000.00	8,946,782.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	4,917,660.00	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	5,500,000.00	4,760,635.00	
	ルーマニアレイ 小計	116,700,000.00	100,168,590.00 (3,007,581,948)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	27,300,000.00	23,726,976.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	9,650,000.00	9,638,516.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	18,650,000.00	18,069,798.50	
	MGS 3.582% 07/15/32	8,500,000.00	7,903,045.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	19,000,000.00	18,362,930.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	18,350,000.00	15,833,114.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,139,263.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	7,558,104.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	6,100,000.00	6,092,619.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	19,604,116.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	10,300,000.00	10,134,376.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	14,450,000.00	14,302,032.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	17,100,000.00	16,959,438.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	23,000,000.00	22,994,940.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000.00	19,693,692.50	
	MGS 4.065% 06/15/50	14,450,000.00	12,396,799.50	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,181,900.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	19,076,171.50	
	MGS 4.504% 04/30/29	3,200,000.00	3,214,304.00	
	MGS 4.696% 10/15/42	6,200,000.00	6,045,372.00	
MGS 4.762% 04/07/37	9,550,000.00	9,623,344.00		
	マレーシアリンギット 小計	290,100,000.00	277,550,851.50 (8,634,218,418)	
タイバーツ	THA IGB 0.75% 06/17/24	102,500,000.00	101,111,125.00	
	THA IGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	138,986,280.00	
	THA IGB 1.45% 12/17/24	197,000,000.00	195,640,700.00	
	THA IGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	48,865,570.00	
	THA IGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	53,590,320.00	
	THA IGB 1.6% 12/17/29	99,100,000.00	92,007,413.00	
	THA IGB 1% 06/17/27	176,000,000.00	164,945,440.00	
	THA IGB 2.125% 12/17/26	113,600,000.00	112,585,552.00	
	THA IGB 2.4% 12/17/23	123,000,000.00	124,448,940.00	
	THA IGB 2.875% 06/17/46	90,100,000.00	74,405,481.00	
	THA IGB 2.875% 12/17/28	111,000,000.00	112,361,970.00	

	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	59,320,992.00	
	THAIGB 2% 12/17/31	31,000,000.00	28,716,850.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	122,700,000.00	118,196,910.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	127,479,056.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	99,000,000.00	100,458,270.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000.00	185,461,380.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	191,820,600.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	111,536,388.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	134,046,735.00	
	タイパーツ 小計	2,320,300,000.00	2,275,985,972.00 (9,012,904,449)	
フィリピン ペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	26,877,600.00	
	フィリピンペソ 小計	30,000,000.00	26,877,600.00 (67,822,935)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,610,861,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,286,900,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	44,000,000,000.00	40,709,680,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	36,500,000,000.00	34,843,995,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	15,151,520,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	16,109,890,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	51,000,000,000.00	47,793,120,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	16,100,000,000.00	15,112,909,000.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	20,000,000,000.00	19,174,400,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	58,990,625,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	50,000,000,000.00	49,691,000,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	18,740,400,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	31,300,000,000.00	31,036,767,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	33,765,060,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	19,627,110,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	34,700,000,000.00	34,641,010,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	18,472,864,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	40,800,000,000.00	40,527,048,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	43,000,000,000.00	42,012,720,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	46,800,000,000.00	47,854,872,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,200,000,000.00	32,606,496,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	36,000,000,000.00	37,882,080,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,065,176,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	53,600,000,000.00	54,804,928,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	46,653,200,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	22,551,076,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	41,816,280,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	25,543,860,000.00	

	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,869,118,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,057,705,000.00	
インドネシアルピア 小計		920,700,000,000.00	921,002,670,000.00	(8,657,425,098)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	189,400,000.00	199,637,070.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	47,163,928.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	64,100,000.00	40,069,551.00	
	SAGB 7% 02/28/31	75,700,000.00	59,993,007.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	129,000,000.00	108,710,880.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	113,700,000.00	90,111,798.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	116,000,000.00	90,751,440.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	158,200,000.00	123,462,444.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	110,000,000.00	92,184,400.00	
	SAGB 8% 01/31/30	182,600,000.00	159,869,952.00	
	SAGB 9% 01/31/40	100,300,000.00	81,345,306.00	
	南アフリカランド 小計		1,311,200,000.00	1,093,299,776.00
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,519,080.00	
	CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,172,868.00	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	3,005,310.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	8,000,000.00	8,028,400.00	
	CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,400,540.00	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,003,720.00	
	CGB 2.6% 09/01/32	6,400,000.00	6,350,784.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,212,367.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,101,900.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,696,381.00	
	CGB 2.75% 06/15/29	6,500,000.00	6,524,310.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,093,000.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,848,707.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,692,192.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	6,900,000.00	6,971,829.00	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,095,440.00	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,101,340.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,390,770.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	15,000,000.00	15,354,300.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,697,710.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	12,900,000.00	13,179,027.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	7,500,000.00	7,677,300.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,563,600.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	15,300,000.00	15,769,710.00	
CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,561,997.00		
CGB 3.22% 12/06/25	5,600,000.00	5,759,040.00		

	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,716,540.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,700,670.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	23,013,100.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,079,949.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,817,984.00	
	CGB 3.29% 10/18/23	10,000,000.00	10,150,300.00	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,500,000.00	8,016,375.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,300,000.00	8,026,277.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	16,500,000.00	18,408,060.00	
	オフショア人民元 小計	418,500,000.00	428,700,877.00 (8,632,363,729)	
	合計		85,562,061,713 (85,562,061,713)	

## 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%	10.1%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	10.1%
チリペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	2.2%
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%	2.6%
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 20銘柄	100.0%	5.6%
ハンガリーフォリント	国債証券 20銘柄	100.0%	3.0%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	7.3%
ルーマニアレイ	国債証券 18銘柄	100.0%	3.5%
マレーシアリングット	国債証券 21銘柄	100.0%	10.1%
タイバーツ	国債証券 20銘柄	100.0%	10.5%
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%	10.1%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	10.5%
オフショア人民元	国債証券 35銘柄	100.0%	10.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### J-REITインデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2022年11月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,736,946,174
投資証券	127,391,746,400
未収入金	91,536,649
未収配当金	1,111,331,754
前払金	118,703,200
差入委託証拠金	231,616,000
流動資産合計	131,681,880,177
資産合計	131,681,880,177
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	118,703,200
未払金	42,979,253
未払解約金	74,675,818
未払利息	6,180
流動負債合計	236,364,451
負債合計	236,364,451
純資産の部	
元本等	
元本	61,225,723,115
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	70,219,792,611
元本等合計	131,445,515,726
純資産合計	131,445,515,726
負債純資産合計	131,681,880,177

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年11月10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>



2022年11月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2022年11月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	61,225,723,115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 2.1469円 (1万口当たり純資産額) (21,469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11月10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。

	2022年11月10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11月10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。
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つた場合、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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月11日
期首元本額	53,594,140,102円
期中追加設定元本額	10,416,602,077円
期中一部解約元本額	2,785,019,064円
期末元本額	61,225,723,115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）	1,729,965,779円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,348,365円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,678,540,579円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	31,882,373,589円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,460,260,510円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,228,904,460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）	1,036,169,457円
S M T インデックスバランス・オープン	26,406,174円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	229,316,589円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	8,445,182円
グローバル経済コア	246,084,185円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,004,824円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	607,009,296円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	112,071,896円
M y S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	214,944,241円
10資産分散投資ファンド	7,002円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	525,180,997円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	19,640,628円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	502,780,878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）	84,403,221円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	582,825,312円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	255,963,362円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	291,868,529円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

	2022年11月10日現在
--	---------------

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	5,505,767,028
合計	5,505,767,028

(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11月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	4,131,657,200	-	4,012,954,000	118,703,200
	合計	4,131,657,200	-	4,012,954,000	118,703,200

(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	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	2,382	274,644,600	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,754	346,869,600	
	S O S i L A 物流リート投資法人	5,478	763,633,200	
	東海道リート投資法人	1,421	169,667,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,046	2,512,566,000	
	森ヒルズリート投資法人	13,779	2,200,506,300	
	産業ファンド投資法人	17,511	2,735,218,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,716	3,948,292,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,404	1,765,680,400	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	6,186	2,681,631,000	

G L P 投資法人	37,821	5,741,227,800	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,451	1,695,261,000	
日本プロロジスリート投資法人	19,201	6,029,114,000	
星野リゾート・リート投資法人	2,049	1,424,055,000	
O n e リート投資法人	2,044	504,663,600	
イオンリート投資法人	12,971	2,089,628,100	
ヒューリックリート投資法人	10,963	1,881,250,800	
日本リート投資法人	3,806	1,370,160,000	
積水ハウス・リート投資法人	35,609	2,848,720,000	
トーセイ・リート投資法人	2,599	347,746,200	
ケネディクス商業リート投資法人	5,094	1,364,682,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,889	548,043,300	
サムティ・レジデンシャル投資法人	3,046	359,428,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	37,892	6,384,802,000	
いちごホテルリート投資法人	1,941	199,728,900	
ラサールロジポート投資法人	14,345	2,338,235,000	
スターアジア不動産投資法人	14,630	814,891,000	
マリモ地方創生リート投資法人	1,463	200,284,700	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,629	2,284,411,500	
大江戸温泉リート投資法人	1,891	127,075,200	
投資法人みらい	14,236	676,210,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,749	386,784,300	
三菱地所物流リート投資法人	4,026	1,803,648,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	4,538	917,129,800	
ザイマックス・リート投資法人	1,901	229,640,800	
タカラレーベン不動産投資法人	5,132	516,792,400	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,108	733,508,800	
日本ビルファンド投資法人	13,670	8,776,140,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,718	7,054,236,000	
日本都市ファンド投資法人	59,122	6,373,351,600	
オリックス不動産投資法人	23,347	4,426,591,200	
日本プライムリアルティ投資法人	8,014	3,129,467,000	
N T T 都市開発リート投資法人	11,264	1,617,510,400	
東急リアル・エステート投資法人	7,856	1,653,688,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	8,028	904,755,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	26,379	4,072,917,600	
森トラスト総合リート投資法人	8,375	1,229,450,000	
インヴィンシブル投資法人	51,574	2,341,459,600	
フロンティア不動産投資法人	4,348	2,247,916,000	
平和不動産リート投資法人	8,008	1,238,036,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,901	2,536,221,000	
福岡リート投資法人	6,060	1,029,594,000	

ケネディクス・オフィス投資法人	6,818	2,290,848,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,601	822,805,700	
大和証券オフィス投資法人	2,449	1,648,177,000	
阪急阪神リート投資法人	5,293	807,182,500	
スターツプロシード投資法人	2,031	472,004,400	
大和ハウスリート投資法人	17,663	5,343,057,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,787	2,811,352,800	
大和証券リビング投資法人	16,237	1,888,363,100	
ジャパンエクセレント投資法人	10,749	1,460,789,100	
合計	696,993	127,391,746,400	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年11月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	364,646,033
コール・ローン	113,018,582
投資証券	84,101,972,004
未収入金	2,082,044
未収配当金	102,682,113
流動資産合計	84,684,400,776
資産合計	84,684,400,776
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	87,716
未払解約金	123,690,371
未払利息	255
流動負債合計	123,778,342
負債合計	123,778,342
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	34,643,734,497
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	49,916,887,937
元本等合計	84,560,622,434
純資産合計	84,560,622,434
負債純資産合計	84,684,400,776

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年11月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2022年11月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	34,643,734,497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) 2.4409円 (24,409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11月10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11月10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。



	2022年11月10日現在

## （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11月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月11日
期首元本額	38,512,077,705円
期中追加設定元本額	4,564,010,311円
期中一部解約元本額	8,432,353,519円
期末元本額	34,643,734,497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）	1,690,527,564円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,334,542円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,484,411,624円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	12,962,660,028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）	489,201,341円
SMT インデックスバランス・オープン	132,826,142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	7,192,112円
グローバル経済コア	237,997,812円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,431,078円

区分	2022年11月10日現在
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)	59,528,635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)	1,112,545,906円
F O F s 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)	207,210,041円
F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	149,051,071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)	34,531,715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
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11月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	25,004,336,841	
合計	25,004,336,841	

(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11月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	37,959,680	-	38,047,396	87,716
	アメリカドル	37,959,680	-	38,047,396	87,716
合計		37,959,680	-	38,047,396	87,716

## (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	674,009.60	
		AGREE REALTY CORP	37,791	2,592,840.51	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	36,712	703,769.04	
		ALEXANDER'S INC	1,190	281,173.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	70,288	10,032,909.12	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	103,284.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	26,331	716,729.82	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	143,210	4,273,386.40	
		AMERICOLD REALTY TRUST	127,511	3,586,884.43	
		APARTMENT INCOME REIT CO	72,989	2,616,655.65	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	72,024	517,852.56	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	100,761	1,561,795.50	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	32,051	361,535.28	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	105,910.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	66,793	10,618,751.14	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,856	40,646.40	
		BOSTON PROPERTIES	67,517	4,776,827.75	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	103,033.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	81,217	511,667.10	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	141,856	3,007,347.20	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	81,949	1,371,006.77	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	102,500.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	50,428	5,515,310.36	
		CARETRUST REIT INC	45,932	863,980.92	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	11,597	328,195.10	
		CENTERSPACE	7,349	448,876.92	
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	305,841.60			
CITY OFFICE REIT INC	25,050	231,462.00			

CLIPPER REALTY INC	7,300	46,939.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,050	377,357.50	
CORPORATE OFFICE PPTYS	53,219	1,393,805.61	
COUSINS PROPERTIES INC	71,685	1,696,067.10	
CTO REALTY GROWTH INC	8,400	165,228.00	
CUBESMART	106,251	4,125,726.33	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	99,846	834,712.56	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	107,280.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	137,142	13,315,116.78	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	136,656.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	83,212	1,332,224.12	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	42,991	664,640.86	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	20,624	3,105,355.68	
ELME COMMUNITIES	41,374	749,696.88	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	68,118	485,000.16	
EPR PROPERTIES	35,511	1,356,165.09	
EQUINIX INC	43,383	25,940,864.85	
EQUITY COMMONWEALTH	52,660	1,363,894.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	82,800	5,116,212.00	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	160,241	9,563,182.88	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	66,851	1,409,887.59	
ESSEX PROPERTY TRUST	30,829	6,392,084.86	
EXTRA SPACE STORAGE INC	63,891	9,687,792.33	
FARMLAND PARTNERS INC	22,851	313,058.70	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,470	3,479,746.50	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	62,519	2,938,393.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	38,562	1,016,879.94	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	128,264.67	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	120,938	6,052,946.90	
GETTY REALTY CORP	20,690	658,355.80	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	356,252.00	
GLADSTONE LAND CORP	15,061	304,985.25	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	304,012.80	
GLOBAL NET LEASE INC	49,084	613,550.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	180,143	3,462,348.46	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	255,424	6,104,633.60	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	18,550	165,651.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	49,792	1,386,209.28	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	338,412	5,685,321.60	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,023	646,233.57	

INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	105,006	1,717,898.16
INDUS REALTY TRUST INC	2,340	124,488.00
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	129,679.06
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,242	1,373,989.92
INVENTRUST PROPERTIES CORP	31,919	791,591.20
INVITATION HOMES INC	274,483	8,182,338.23
IRON MOUNTAIN INC	137,603	6,765,939.51
ISTAR INC	40,416	398,097.60
JBG SMITH PROPERTIES	47,111	871,553.50
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	249,100.00
KILROY REALTY CORPORATION	49,792	2,036,492.80
KIMCO REALTY CORP	292,774	6,080,915.98
KITE REALTY GROUP TRUST	103,723	2,130,470.42
LIFE STORAGE INC	39,946	4,057,315.22
LTC PROPERTIES INC	19,175	735,744.75
LXP INDUSTRIAL TRUST	132,496	1,328,934.88
MACERICH CO/THE	101,670	1,175,305.20
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	296,483.22
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	283,552	3,187,124.48
MID-AMERICA APARTMENT COMM	54,646	8,320,399.96
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	83,841	3,679,781.49
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	40,398	1,511,693.16
NATL HEALTH INVESTORS INC	21,139	1,153,978.01
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	63,086	393,656.64
NETSTREIT CORP	23,831	434,915.75
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,806	480,002.52
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	340,399.92
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	110,823	3,434,404.77
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	196,659.13
ORION OFFICE REIT INC	30,374	281,870.72
PARAMOUNT GROUP INC	80,008	504,850.48
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	106,435	1,227,195.55
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	62,226	915,966.72
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	55,243	1,653,422.99
PHYSICIANS REALTY TRUST	107,135	1,511,674.85
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	58,412	585,872.36
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,286	335,521.26
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	106,820.00
PRIME US REIT	295,000	141,600.00
PROLOGIS INC	439,354	47,797,321.66
PUBLIC STORAGE	75,268	21,429,552.28
REALTY INCOME CORP	294,425	18,622,381.25

	REGENCY CENTERS CORP	72,902	4,535,233.42
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	58,955	844,825.15
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	80,979	4,340,474.40
	RLJ LODGING TRUST	77,042	852,084.52
	RPT REALTY	43,950	443,016.00
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	26,109	2,198,377.80
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	109,335	1,334,433.67
	SAFEHOLD INC	8,335	230,629.45
	SAUL CENTERS INC	6,800	267,376.00
	SERVICE PROPERTIES TRUST	78,173	558,155.22
	SIMON PROPERTY GROUP	156,090	17,625,682.80
	SITE CENTERS CORP	88,151	1,081,612.77
	SL GREEN REALTY CORP	30,439	1,128,982.51
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	64,541	2,479,019.81
	STAG INDUSTRIAL INC	84,837	2,631,643.74
	STORE CAPITAL CORP	125,789	3,968,642.95
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	405,220.50
	SUN COMMUNITIES INC	58,379	7,788,926.18
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100,505	1,002,034.85
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	49,407	890,808.21
	TERRENO REALTY CORP	31,471	1,752,305.28
	UDR INC	144,582	5,430,499.92
	UMH PROPERTIES INC	25,129	422,167.20
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,793	230,016.07
	URBAN EDGE PROPERTIES	55,595	791,672.80
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	273,759.50
	VENTAS INC	189,214	7,899,684.50
	VERIS RESIDENTIAL INC	37,510	555,148.00
	VICI PROPERTIES INC	459,464	14,486,899.92
	VORNADO REALTY TRUST	76,257	1,715,782.50
	WELLTOWER INC	221,128	14,705,012.00
	WHITESTONE REIT	23,074	207,666.00
	WP CAREY INC	98,249	7,706,651.56
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	54,132	758,389.32
	アメリカドル 小計	12,568,769	447,573,153.26 (65,529,185,368)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	29,679	743,162.16
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	277,216.20
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	139,560.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,047	444,750.52
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	175,465.00

BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	69,600.00	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	39,175	1,613,618.25	
CHOICE PROPERTIES REIT	76,025	1,037,741.25	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	407,691.18	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	430,092.30	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	59,149	682,579.46	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	212,551.60	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	71,700.00	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	49,695	826,427.85	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,334	1,141,616.30	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	61,841	721,066.06	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	29,406.00	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,790	387,909.20	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	21,900	355,656.00	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	147,963.00	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	199,537.20	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	154,384.60	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	48,099	527,165.04	
PRIMARIS REIT	28,309	423,785.73	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	93,920.00	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	70,377	1,433,579.49	
SLATE GROCERY REIT	17,300	261,230.00	
SLATE OFFICE REI	17,000	78,200.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	30,663	842,312.61	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	39,728	887,920.80	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	154,542.00	
カナダドル 小計	901,473	14,972,349.80 (1,620,008,248)	
ユーロ			
AEDIFICA	18,867	1,502,756.55	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	59,544.00	
ALTAREA	2,480	320,416.00	
CARE PROPERTY INVEST	15,000	241,200.00	
CARMILA	26,392	359,986.88	
COFINIMMO	14,199	1,243,122.45	
COVIVIO(FP)	21,972	1,238,122.20	
CROMWELL REIT EUR	170,400	260,712.00	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	17,493	392,542.92	
GECINA SA	25,736	2,380,580.00	

	HAMBORNER REIT AG	37,000	271,210.00
	ICADE	15,570	599,133.60
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	104,242.15
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	141,272	774,170.56
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	258,335.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	234,360.00
	KLEPIERRE	92,974	1,914,334.66
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	133,960.00
	MERCIALYS	36,384	330,912.48
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	157,888	1,375,204.48
	MONTEA NV	4,970	330,505.00
	NSI NV	10,050	253,260.00
	RETAIL ESTATES	5,335	322,767.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	49,378	2,391,870.32
	VASTNED RETAIL	10,650	222,052.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	66,064	1,758,623.68
	WERELDHAVE NV	22,670	294,483.30
	XIOR STUDENT HOUSING NV	9,813	292,918.05
	ユーロ 小計	1,269,647	19,861,326.28 (2,912,862,112)
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	260,756	137,679.16
	AEW UK REIT PLC	68,000	60,996.00
	ASSURA PLC	1,400,809	776,748.59
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	347,371.20
	BIG YELLOW GROUP PLC	82,773	922,918.95
	BRITISH LAND CO PLC	446,042	1,703,880.44
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	354,157	386,031.13
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	204,971.60
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	204,522.94
	DERWENT LONDON PLC	53,156	1,232,156.08
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	69,520.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	269,586.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	109,600	577,044.00
	HAMMERSON PLC	1,673,646	379,415.54
	HOME REIT PLC	374,236	309,493.17
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	229,355	238,070.49
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	355,654	2,126,810.92
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	464,236	851,408.82
	LXI REIT PLC	811,588	983,644.65
NEWRIVER REIT PL	126,000	88,704.00	



	PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	231,820.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	630,955	721,181.56	
	PRS REIT PLC/THE	260,002	223,601.72	
	REGIONAL REIT LTD	222,000	139,194.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	98,896	893,525.36	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	161,000.00	
	SEGRE PLC	572,354	4,527,320.14	
	SHAFTESBURY PLC	139,823	525,734.48	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	589,189	606,864.67	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	138,234.48	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	888,708	1,245,968.61	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	405,972	254,544.44	
	UNITE GROUP PLC	190,394	1,724,969.64	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	223,421	320,609.13	
	WAREHOUSE REIT PLC	230,000	277,840.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	65,316	284,908.39	
	イギリスポンド 小計	14,029,027	24,157,560.30	(4,021,509,063)
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	194,329	522,745.01	
	ARENA REIT	161,278	624,145.86	
	BWP TRUST	228,066	909,983.34	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	274,928	467,377.60	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	255,476	745,989.92	
	CENTURIA OFFICE REIT	240,945	371,055.30	
	CHARTER HALL GROUP	223,905	2,944,350.75	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	286,964	1,228,205.92	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	244,874	981,944.74	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	157,784	525,420.72	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	468,608.00	
	DEXUS	509,145	3,956,056.65	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	301,710.00	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	251,487.50	
	GOODMAN GROUP	804,776	13,785,812.88	
	GPT GROUP	906,785	3,899,175.50	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	445,580.10	
	HEALTHCO REIT	137,130	193,353.30	
	HOME CONSORTIUM LTD	92,191	433,297.70	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	734,103	924,969.78	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	365,443.50	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	173,646	694,584.00	
MIRVAC GROUP	1,867,868	3,922,522.80		
NATIONAL STORAGE REIT	473,590	1,155,559.60		
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	140,120.40		

	RURAL FUNDS GROUP	181,331	444,260.95	
	SCENTRE GROUP	2,456,991	7,125,273.90	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	528,421	1,395,031.44	
	STOCKLAND	1,130,026	4,034,192.82	
	VICINITY CENTERS	1,831,690	3,562,637.05	
	WAYPOINT REIT LTD	336,956	923,259.44	
	オーストラリアドル 小計	15,987,473	57,744,156.47 (5,435,457,448)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	488,215.26	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	498,199	1,021,307.95	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	743,753	639,627.58	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	556,295	667,554.00	
	STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	465,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	181,387	426,259.45	
	ニュージーランドドル 小計	2,696,912	3,707,964.24 (319,552,358)	
香港ドル	CHAMPION REIT	745,000	1,840,150.00	
	FORTUNE REIT	605,000	3,121,800.00	
	LINK REIT	997,800	49,690,440.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	1,210,720.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,525,920.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,315,660	2,039,273.00	
	香港ドル 小計	4,976,460	59,428,303.00 (1,108,337,850)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	335,500.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,581,818	4,096,908.62	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	847,977	809,818.03	
	CAPITALAND CHINA TRUST	553,921	545,612.18	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,383,544	4,528,733.60	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	485,438.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400	188,830.00	
	EC WORLD REIT	180,000	79,200.00	
	ESR-LOGOS REIT	2,418,564	846,497.40	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	326,700.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	137,215.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	469,862	916,230.90	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,364,796	1,514,923.56	
	KEPPEL DC REIT	626,303	1,102,293.28	
	KEPPEL REIT	936,300	833,307.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	883,950	592,246.50	

	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	941,863	2,053,261.34	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,523,285	2,284,927.50	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	1,090,073	1,722,315.34	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	407,566.08	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	163,200	660,960.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	211,497.00	
	SPH REIT	409,600	352,256.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	849,400	437,441.00	
	SUNTEC REIT	1,060,900	1,410,997.00	
	シンガポールドル 小計	21,934,200	26,880,675.83 (2,807,955,397)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	90,509,200.00	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	68,508,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	299,737,900.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	49,794,525.00	
	JR REIT XXVII	76,683	313,633,470.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	119,153,605.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	256,216,800.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	172,659,000.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	46,117,665.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	36,380	251,022,000.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	52,543,700.00	
	SK REITS CO LTD	39,229	177,707,370.00	
	韓国ウォン 小計	456,338	1,897,603,235.00 (203,802,587)	
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	617,760.00	
	REIT 1 LTD	103,500	1,857,825.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	1,003,605.00	
	イスラエルシェケル 小計	578,500	3,479,190.00 (143,301,573)	
	合計	75,398,799	84,101,972,004 (84,101,972,004)	

(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%	77.9%

カナダドル	投資証券	31銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券	28銘柄	100.0%	3.5%
イギリスポンド	投資証券	37銘柄	100.0%	4.8%
オーストラリアドル	投資証券	31銘柄	100.0%	6.5%
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%	1.3%
シンガポールドル	投資証券	25銘柄	100.0%	3.3%
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。

## 2【ファンドの現況】

## 【SMT 8資産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	150,155,222円
負債総額	68,199円
純資産総額（ - ）	150,087,023円
発行済口数	113,477,497口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3226円
（1万口当たり純資産額）	（13,226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）

## 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）

## 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）

## 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）

## 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します。）に支払います。

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。



## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2022年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 2月10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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
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おります。

#### 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）\*2、\*3及び（注2）参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先度が最も低いレベルに時価を分類しております。

### (1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950

デリバティブ取引（*2）	
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(431)

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（\*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2022年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1、*2）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	-	196	-	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	-	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(71)	-	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	-	(1,485)

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（\*2）投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

（\*3）金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

（\*4）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（2）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

#### デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-

未収運用受託報酬	6,151	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

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

## 2. その他有価証券

前事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2021年3月31日)

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

##### (2) 株式関連

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

#### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

当事業年度（2022年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
	合計	6,915	-	80	80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## (2) 株式関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引				
株価指数先物取引 売建	17,197	-	1,333	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
--------------	----	---------	---------------	-------------------------	-------------



原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
合計			8,057	-	71

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は従来簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

(単位：百万円)

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

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

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

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

### 3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

#### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

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

## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

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

## 〔関連情報〕

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

## 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

## 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

## (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（2021年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2022年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

## (1株当たり情報)

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

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

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 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	
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	投資有価証券 関係会社株式			
	売建				
	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2月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円(2022年3月末日現在)

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額(百万円) (2022年3月末日現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	17,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。



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。
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。
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。
株式会社三十三銀行	37,461	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
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。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2022年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2022年 8月10日	有価証券届出書
2022年 8月10日	有価証券報告書

**独立監査人の監査報告書**

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2023年1月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘

## 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 8資産インデックスバランス・オープンの2022年5月11日から2022年11月10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 8資産インデックスバランス・オープンの2022年11月10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。