

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年3月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

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

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

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

### （６）【申込単位】

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

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

**( 7 ) 【申込期間】**

2023年 3月11日から2023年 9月12日までとします。

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第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。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

当ファンドは、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）並びに債券に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。



###### 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。

###### <信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

###### 商品分類表

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

(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)  日本	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	北米  欧州  アジア  オセアニア				
不動産投信	その他 ( )	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券)資産 配分固定型))		アフリカ  中近東 (中東)				
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。

## &lt; 商品分類表定義 &gt;

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

るものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

[ 投資対象資産による属性区分 ]

(1) 株式

一般... 次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般... 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信... これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産... 組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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



(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[ 投資形態による属性区分 ]

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

[ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

[ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

## [ 特殊型 ]

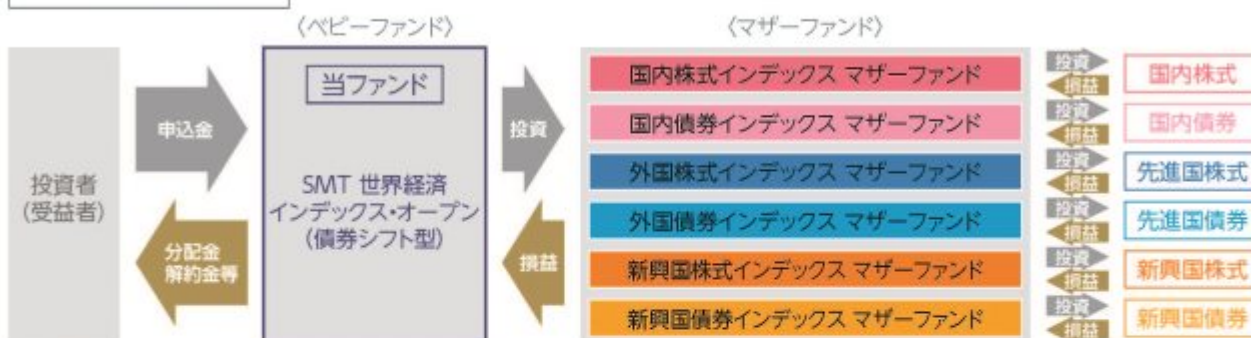
- (1) プル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款に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

## &lt; ファンドの特色 &gt;

**特色1** 世界の株式及び債券に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 世界の株式及び債券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。

## ファンドのしくみ



## ? 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。

**特色2** 世界経済全体の発展を享受します。

- 基本組入比率は、地域別(日本、先進国、新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率に基づき決定します。  
※年1回地域別構成比の見直しを行います。

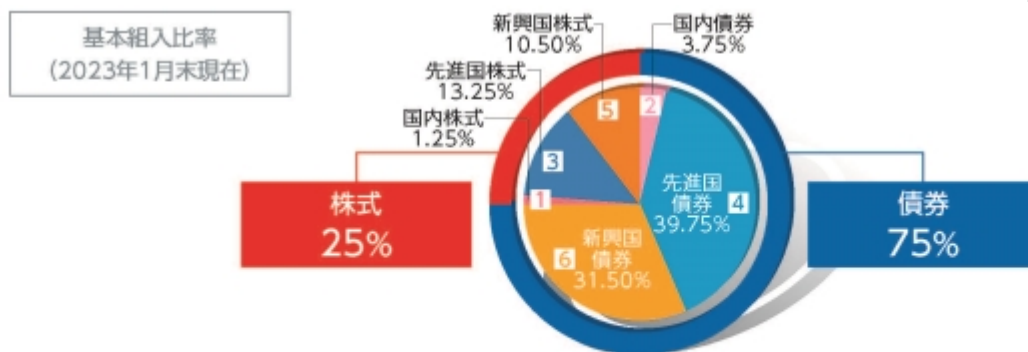


(出所) IMF「世界経済見通し2022年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

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

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

※上記のファンドの地域別構成比は、2023年1月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



- 組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
- 基本組入比率は年1回見直しを行います。

資産	インデックス
1 国内株式	TOPIX(東証株価指数) ※1
2 国内債券	NOMURA-BPI総合 ※2
3 先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス(円ベース) ※3
4 先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) ※4
5 新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース) ※5
6 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・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

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

- ※1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※2 「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。
- ※3 「MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※4 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ※5 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※6 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド」とは、新興国の現地通貨債市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

## ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

### 分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### 主な投資制限

- 株式、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35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

### 〈ご参考情報〉

#### 世界人口・名目GDP総額の推移



(出所)国連「World Population Prospects 2022」及びIMF「世界経済見通し2022年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

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

※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

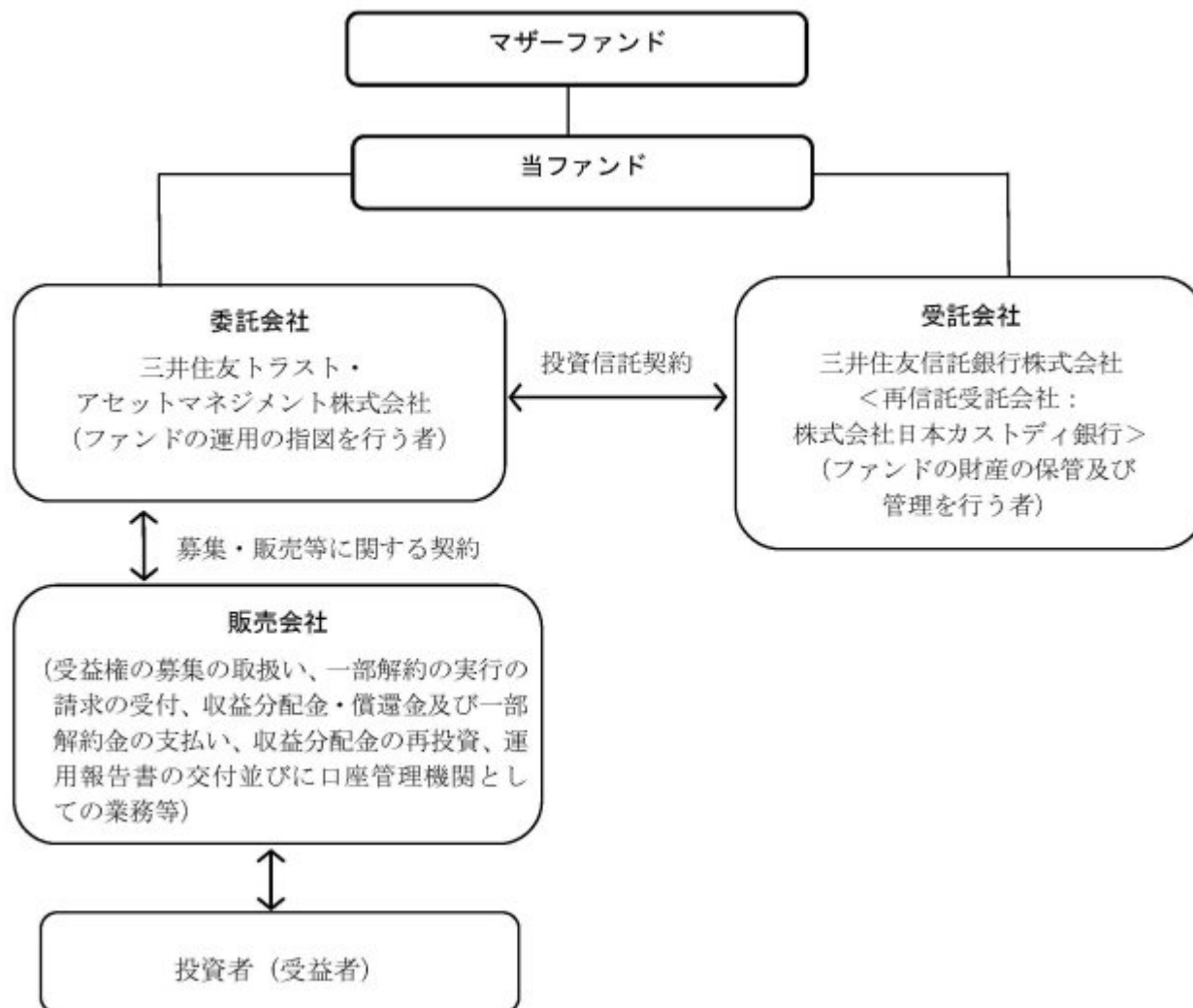
### (2) 【ファンドの沿革】

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12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、主として、「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」及び「新興国債券インデックス 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。）への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）並びに債券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

### 投資対象

各マザーファンド受益証券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並びに債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．株式と債券の基本資産配分比率は、株式25%、債券75%とします。
- ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））総額の比率に基づき決定します。また、各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、年1回見直しを行います。
- ホ．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）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合
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）
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）
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）

- ヘ．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。
- ト．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す。）
3. 金銭債権
4. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によって



は、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、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並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）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。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

## 3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

### <約款に定める投資制限>

#### イ．株式等への投資割合

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35%以下とします。

#### ロ．投資信託証券への投資割合

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

#### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

#### ニ．投資する株式等の範囲

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

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

#### ホ．信用取引の指図範囲

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

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

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権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（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）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に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

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

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

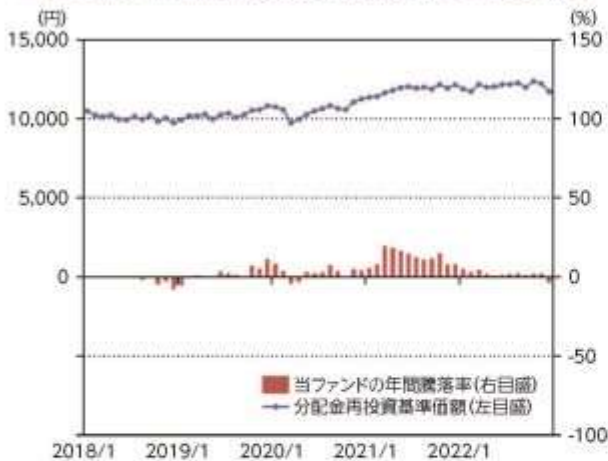
## (2) リスクの管理体制

## 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

## 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*当ファンドについては2018年8月～2022年12月の4年5ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2018年1月～2022年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

\*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケットベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は総額は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利ノウハウ及び同指数に係る標準又は総額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、取扱い及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIロクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村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表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村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。
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により提供されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産権の一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・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、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用してはなりません。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0.495%（税抜 0.45%）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 0.198% （税抜 0.18%）	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 0.242% （税抜 0.22%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

#### （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ます。）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12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12月30日現在の状況について記載してあります。

### 【SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

#### （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	4,537,869,922	99.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		45,964,253	1.00
合計（純資産総額）		4,583,834,175	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### （2）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	601,830,897	3.1483	1,894,752,147	2.9688	1,786,715,567	38.98
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	784,293,301	1.8114	1,420,683,167	1.7853	1,400,198,830	30.55
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	159,259,562	4.2938	683,840,511	4.1207	656,260,877	14.32

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	129,100,650	3.6912	476,546,606	3.3780	436,101,995	9.51
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	140,031,927	1.3748	192,516,142	1.3351	186,956,625	4.08
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	37,800,659	1.9168	72,458,161	1.8951	71,636,028	1.56

(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	99.00
合計	99.00

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2018年 6月11日)	545,359,273	545,359,273	10,037	10,037
第2期計算期間末	(2019年 6月10日)	823,199,920	823,199,920	10,104	10,104
第3期計算期間末	(2020年 6月10日)	1,375,543,408	1,375,543,408	10,625	10,625
第4期計算期間末	(2021年 6月10日)	2,387,407,826	2,387,407,826	12,027	12,027
第5期計算期間末	(2022年 6月10日)	4,030,020,115	4,030,020,115	12,294	12,294
	2021年12月末日	3,405,781,382		12,139	
	2022年 1月末日	3,506,080,135		11,886	
	2月末日	3,547,491,426		11,726	
	3月末日	3,803,631,046		12,161	
	4月末日	3,815,230,832		11,999	
	5月末日	3,925,008,101		12,017	
	6月末日	4,057,627,429		12,159	
	7月末日	4,157,576,291		12,168	
	8月末日	4,271,648,781		12,259	

9月末日	4,283,427,672		11,978
10月末日	4,562,035,028		12,362
11月末日	4,630,577,397		12,213
12月末日	4,583,834,175		11,714

## 【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～2018年 6月11日	0
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0
第3期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	0
第4期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	0
第5期計算期間	2021年 6月11日～2022年 6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～2018年 6月11日	0.4
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0.7
第3期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	5.2
第4期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	13.2
第5期計算期間	2021年 6月11日～2022年 6月10日	2.2
第6期中間計算期間	2022年 6月11日～2022年12月10日	0.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年 8月25日～2018年 6月11日	755,925,234	212,584,152	543,341,082
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	566,171,068	294,755,895	814,756,255
第3期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	723,541,962	243,618,762	1,294,679,455
第4期計算期間	2020年 6月11日～2021年 6月10日	923,844,272	233,468,732	1,985,054,995
第5期計算期間	2021年 6月11日～2022年 6月10日	1,555,340,467	262,475,209	3,277,920,253
第6期中間計算期間	2022年 6月11日～2022年12月10日	712,341,149	150,598,501	3,839,662,901

(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	490,165,608,950	98.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,160,901,770	1.04
合計(純資産総額)		495,326,510,720	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	5,031,390,000	1.02

(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	9,875,200	2,117.06	20,906,432,545	1,812.50	17,898,800,000	3.61
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,272,200	11,938.63	15,188,326,022	10,035.00	12,766,527,000	2.58
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,247,400	738.13	8,302,043,362	889.00	9,998,938,600	2.02
日本	株式	キーエンス	電気機器	179,900	51,541.91	9,272,390,884	51,420.00	9,250,458,000	1.87
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,311,300	3,983.17	9,206,316,589	3,762.00	8,695,110,600	1.76
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,294,300	3,993.11	5,168,294,612	5,296.00	6,854,612,800	1.38
日本	株式	第一三共	医薬品	1,571,400	3,552.63	5,582,605,919	4,250.00	6,678,450,000	1.35
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,596,300	3,750.59	5,987,067,425	4,111.00	6,562,389,300	1.32
日本	株式	任天堂	その他製品	1,135,400	5,833.06	6,622,859,188	5,532.00	6,281,032,800	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	912,000	6,773.07	6,177,048,101	6,691.00	6,102,192,000	1.23
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,042,900	5,368.83	5,599,158,077	5,644.00	5,886,127,600	1.19

日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,368,800	4,678.19	6,403,509,909	4,177.00	5,717,477,600	1.15
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,393,800	4,532.04	6,316,768,902	3,982.00	5,550,111,600	1.12
日本	株式	三井物産	卸売業	1,392,300	3,192.29	4,444,625,807	3,853.00	5,364,531,900	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,189,700	4,484.17	5,334,828,807	4,283.00	5,095,485,100	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,783,600	2,475.33	4,415,010,147	2,827.50	5,043,129,000	1.02
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	126,900	58,791.72	7,460,670,476	38,880.00	4,933,872,000	1.00
日本	株式	信越化学工業	化学	304,000	18,170.91	5,523,956,640	16,225.00	4,932,400,000	1.00
日本	株式	HOYA	精密機器	384,200	13,943.27	5,357,004,334	12,705.00	4,881,261,000	0.99
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,172,500	3,728.08	4,371,185,186	4,146.00	4,861,185,000	0.98
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,561,600	1,537.36	3,938,124,581	1,856.00	4,754,329,600	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,461,900	3,189.50	4,662,740,016	3,032.00	4,432,480,800	0.89
日本	株式	ダイキン工業	機械	216,800	20,710.74	4,490,089,414	20,200.00	4,379,360,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,897,700	1,492.06	4,323,567,057	1,488.00	4,311,777,600	0.87
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	195,700	19,680.58	3,851,489,926	19,160.00	3,749,612,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	655,800	5,412.40	3,549,453,935	5,660.00	3,711,828,000	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	545,500	8,212.80	4,480,087,260	6,588.00	3,593,754,000	0.73
日本	株式	ファナック	電気機器	176,500	21,324.65	3,763,801,308	19,835.00	3,500,877,500	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,728,600	2,045.38	3,535,653,052	2,006.50	3,468,435,900	0.70
日本	株式	S M C	機械	58,900	66,142.27	3,895,779,745	55,580.00	3,273,662,000	0.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.31
		建設業	1.95
		食料品	3.49
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.06
		医薬品	5.74
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.69
		鉄鋼	0.76
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.55
		機械	4.98
電気機器	16.39		

	輸送用機器	7.23
	精密機器	2.55
	その他製品	2.32
	電気・ガス業	1.26
	陸運業	3.08
	海運業	0.63
	空運業	0.52
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	8.86
	卸売業	5.98
	小売業	4.72
	銀行業	6.40
	証券、商品先物取引業	0.74
	保険業	2.52
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.96
	サービス業	5.32
	小計	98.96
合計		98.96

(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	266	円	5,088,489,700	5,031,390,000	1.02

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

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

#### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	519,131,816,680	84.35
地方債証券	日本	32,182,293,635	5.23

特殊債券	日本	35,785,264,672	5.81
社債券	日本	26,066,966,000	4.24
	フランス	791,861,000	0.13
	スペイン	394,724,000	0.06
	小計	27,253,551,000	4.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,111,727,049	0.18
合計(純資産総額)		615,464,653,036	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	100.11	7,659,103,500	0.100	2024/9/20	1.24
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	99.40	6,819,457,400	0.005	2026/12/20	1.11
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	99.70	6,660,427,600	0.005	2026/6/20	1.08
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	99.10	6,332,553,900	0.100	2028/3/20	1.03
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	6,237,000,000	98.85	6,165,875,500	96.69	6,030,804,780	0.100	2031/12/20	0.98
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	99.90	5,894,513,000	0.100	2026/9/20	0.96
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	99.64	5,729,587,500	0.100	2027/3/20	0.93
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,740,000,000	99.94	5,736,839,300	99.39	5,705,215,600	0.100	2027/9/20	0.93
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	100.10	5,596,037,200	0.100	2024/3/20	0.91
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	100.12	5,436,570,300	0.100	2025/9/20	0.88
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,340,000,000	99.88	5,333,772,600	99.09	5,291,619,600	0.005	2027/6/20	0.86
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,370,000,000	99.71	5,354,427,000	98.09	5,267,594,100	0.200	2032/3/20	0.86
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	5,335,000,000	100.12	5,341,402,000	98.59	5,260,203,300	0.100	2028/12/20	0.85
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	97.95	5,250,334,400	0.200	2032/6/20	0.85
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	100.70	5,156,249,600	0.300	2025/12/20	0.84
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	5,300,000,000	99.07	5,250,995,000	96.67	5,123,775,000	0.100	2031/6/20	0.83
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	5,110,000,000	100.45	5,132,995,000	100.12	5,116,234,200	0.100	2025/6/20	0.83
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	96.62	4,937,333,100	0.100	2031/9/20	0.80
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	99.26	4,893,764,500	0.100	2027/12/20	0.80

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	99.55	4,798,599,200	0.005	2026/9/20	0.78
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	4,820,000,000	100.27	4,833,014,000	98.92	4,768,233,200	0.100	2028/6/20	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	100.11	4,765,283,600	0.100	2026/3/20	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	100.12	4,755,747,500	0.100	2025/3/20	0.77
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	97.10	4,748,287,800	0.100	2030/9/20	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	98.42	4,714,365,900	0.100	2029/3/20	0.77
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	100.85	4,710,115,300	0.400	2025/6/20	0.77
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	96.90	4,631,867,800	0.100	2030/12/20	0.75
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	100.78	4,595,659,200	0.400	2025/3/20	0.75
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	100.93	4,471,331,900	0.400	2025/9/20	0.73
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	4,380,000,000	100.42	4,398,396,000	99.39	4,353,457,200	0.100	2027/9/20	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.35
地方債証券	5.23
特殊債券	5.81
社債券	4.43
合計	99.82

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	343,824,216,962	66.11



	イギリス	22,861,445,448	4.40
	カナダ	19,070,447,884	3.67
	スイス	17,317,086,921	3.33
	フランス	16,914,826,480	3.25
	ドイツ	12,439,549,440	2.39
	オーストラリア	11,163,076,730	2.15
	オランダ	9,481,914,702	1.82
	アイルランド	9,348,198,657	1.80
	スウェーデン	4,868,357,413	0.94
	デンマーク	4,539,367,098	0.87
	スペイン	3,809,570,929	0.73
	香港	3,389,701,257	0.65
	イタリア	2,712,258,550	0.52
	フィンランド	1,947,715,250	0.37
	シンガポール	1,892,816,715	0.36
	ジャージー	1,713,002,957	0.33
	ベルギー	1,344,828,135	0.26
	ノルウェー	1,190,872,705	0.23
	イスラエル	1,129,187,629	0.22
	ケイマン	985,880,253	0.19
	バミューダ	804,820,971	0.15
	キュラソー	784,775,781	0.15
	ニュージーランド	382,989,714	0.07
	ルクセンブルク	359,642,645	0.07
	ポルトガル	294,398,707	0.06
	オーストリア	291,752,920	0.06
	リベリア	133,352,114	0.03
	マン島	105,572,936	0.02
	パナマ	90,453,214	0.02
	小計	495,192,081,117	95.22
投資信託受益証券	オーストラリア	151,858,545	0.03
	香港	70,774,521	0.01
	小計	222,633,066	0.04
投資証券	アメリカ	9,821,438,769	1.89
	オーストラリア	648,384,932	0.12
	シンガポール	248,050,573	0.05
	イギリス	235,179,635	0.05
	フランス	209,174,807	0.04
	香港	164,828,488	0.03
	カナダ	52,349,612	0.01
	ベルギー	49,473,632	0.01
	小計	11,428,880,448	2.20

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,210,864,756	2.54
合計(純資産総額)		520,054,459,387	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	10,095,801,071	1.94
	買建	カナダ	599,940,400	0.12
	買建	ドイツ	2,137,973,557	0.41
	買建	イギリス	360,096,000	0.07
	買建	オーストラリア	436,447,739	0.08

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,980,142,822	0.38

(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	1,306,830	19,901.01	26,007,248,660	17,199.24	22,476,491,957	4.32
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	576,193	36,265.58	20,895,975,065	31,982.02	18,427,820,083	3.54
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	745,078	15,341.44	11,430,574,648	11,170.68	8,323,032,384	1.60
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	487,097	14,911.49	7,263,346,429	11,737.31	5,717,210,925	1.10
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	75,741	67,371.78	5,102,806,746	70,315.07	5,325,734,171	1.02

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	450,619	14,987.13	6,753,489,139	11,803.66	5,318,955,719	1.02
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	213,641	23,961.63	5,119,188,518	23,562.21	5,033,854,534	0.97
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	337,717	12,934.26	4,368,122,524	14,490.83	4,893,803,012	0.94
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	105,336	42,275.56	4,453,139,020	41,012.26	4,320,067,630	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	237,146	17,398.29	4,125,936,540	17,678.29	4,192,336,709	0.81
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	193,177	19,709.93	3,807,505,341	20,248.69	3,911,581,768	0.75
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半 導体製造装 置	201,710	24,882.57	5,019,064,607	19,378.18	3,908,772,890	0.75
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	132,153	28,243.86	3,732,511,888	27,609.56	3,648,686,447	0.70
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	149,982	23,594.06	3,538,684,307	23,663.06	3,549,033,665	0.68
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	82,622	40,939.27	3,382,484,944	42,518.40	3,512,955,823	0.68
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自 動車部品	215,924	33,589.02	7,252,676,418	16,165.51	3,490,522,445	0.67
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲 料・タバコ	223,071	16,751.45	3,736,764,845	15,561.29	3,471,273,057	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェ ア・サービ ス	69,590	47,457.50	3,302,567,495	46,207.46	3,215,577,629	0.62
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	65,684	42,874.04	2,816,138,640	48,703.55	3,199,044,241	0.62
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	455,154	7,123.33	3,242,214,874	6,811.49	3,100,277,375	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	143,704	19,871.82	2,855,660,740	21,571.71	3,099,941,301	0.60
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	205,996	12,347.73	2,543,584,019	14,705.81	3,029,338,861	0.58
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・ 娯楽	183,946	25,847.30	4,754,508,550	15,958.50	2,935,502,609	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲 料・タバコ	331,360	8,571.09	2,840,117,376	8,486.16	2,811,975,634	0.54
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバコ	111,310	22,791.22	2,536,891,255	24,148.74	2,687,996,917	0.52
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	583,269	4,909.89	2,863,792,463	4,397.67	2,565,029,249	0.49
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半 導体製造装 置	32,570	77,227.41	2,515,297,037	74,021.38	2,410,876,575	0.46
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半 導体製造装 置	32,784	76,545.17	2,509,456,948	73,097.54	2,396,430,046	0.46
デンマー ク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	133,518	14,108.65	1,883,759,478	17,895.91	2,389,427,179	0.46

スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	56,665	47,293.33	2,679,876,816	42,094.25	2,385,271,186	0.46
-----	----	----------------------	------------------------	--------	-----------	---------------	-----------	---------------	------

(注1)国ノ地域は、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	国内ノ外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.78
		素材	4.39
		資本財	6.61
		商業・専門サービス	1.22
		運輸	1.86
		自動車・自動車部品	1.49
		耐久消費財・アパレル	1.61
		消費者サービス	1.86
		メディア・娯楽	4.64
		小売	4.27
		食品・生活必需品小売り	1.51
		食品・飲料・タバコ	4.41
		家庭用品・パーソナル用品	1.86
		ヘルスケア機器・サービス	5.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.48
		銀行	5.96
		各種金融	4.71
		保険	3.42
		不動産	0.39
		ソフトウェア・サービス	10.18
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.76		
電気通信サービス	1.42		
公益事業	3.25		
半導体・半導体製造装置	4.12		
		小計	95.22
投資信託受益証券			0.04
投資証券			2.20
合計			97.46

(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	393	アメリカドル	77,950,381	10,344,015,558	76,079,887.5	10,095,801,071	1.94
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	26	カナダドル	6,247,207	611,539,092	6,128,720	599,940,400	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	49	スイスフラン	5,352,843	769,417,653	5,279,750	758,911,265	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	253	ユーロ	9,955,433.5	1,408,395,177	9,748,090	1,379,062,292	0.27
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	28	オーストラリアドル	4,978,121	445,890,298	4,872,700	436,447,739	0.08
	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	2,242,242.5	358,758,800	2,250,600	360,096,000	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	11,000,000.00	1,468,370,000	1,458,538,800	0.28
	カナダドル	買建	700,000.00	69,005,300	68,473,300	0.01
	ユーロ	買建	1,400,000.00	198,995,000	197,979,240	0.04
	イギリスポンド	買建	500,000.00	80,675,500	79,950,000	0.02
	スイスフラン	買建	400,000.00	57,476,400	57,484,400	0.01
	オーストラリアドル	買建	840,000.00	75,976,320	75,200,832	0.01
	香港ドル	買建	2,500,000.00	42,497,500	42,516,250	0.01

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

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

## 外国債券インデックス 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	143,790,304,546	49.50
	フランス	24,261,758,557	8.35

イタリア	21,242,780,763	7.31
ドイツ	18,976,196,540	6.53
スペイン	14,296,325,641	4.92
イギリス	13,126,363,780	4.52
中国	10,289,458,037	3.54
カナダ	5,791,268,628	1.99
ベルギー	5,286,109,252	1.82
オランダ	4,520,565,310	1.56
オーストラリア	4,473,142,673	1.54
オーストリア	3,338,333,198	1.15
メキシコ	2,428,524,666	0.84
アイルランド	1,807,572,366	0.62
マレーシア	1,564,914,663	0.54
フィンランド	1,460,653,932	0.50
シンガポール	1,357,266,030	0.47
ポーランド	1,263,274,577	0.43
イスラエル	1,022,054,193	0.35
デンマーク	943,646,148	0.32
ニュージーランド	632,466,631	0.22
ノルウェー	597,764,280	0.21
スウェーデン	582,682,140	0.20
小計	283,053,426,551	97.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	7,454,605,210	2.57
合計(純資産総額)	290,508,031,761	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	2,562,538,644	0.88
	買建	ドイツ	2,197,941,581	0.76

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		5,307,081,712	1.83

(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 2.75% 08/15/32	13,800,000	12,299.85	1,697,379,603	12,129.60	1,673,886,094	2.750	2032/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	12,091.76	1,753,306,530	11,430.86	1,657,474,835	1.250	2028/9/30	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	13,144.55	1,753,483,916	12,310.77	1,642,257,508	2.625	2029/2/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	12,777.55	1,661,082,625	12,589.13	1,636,587,551	0.250	2024/3/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	11,631.98	1,750,613,647	10,865.07	1,635,193,284	1.125	2031/2/15	0.56
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	79,870,000	1,887.71	1,507,718,547	1,883.71	1,504,525,795	1.990	2025/4/9	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	12,997.69	1,519,430,302	12,399.15	1,449,461,366	2.375	2027/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	13,380,000	11,635.13	1,556,781,197	10,808.31	1,446,152,060	1.250	2031/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	11,530,000	12,693.59	1,463,571,655	12,301.70	1,418,386,549	2.250	2027/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	12,217.21	1,445,296,188	11,771.42	1,392,559,342	0.750	2026/8/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.5% 04/30/27	11,940,000	11,692.00	1,396,025,066	11,442.78	1,366,268,317	0.500	2027/4/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	12,693.58	1,378,523,263	12,396.04	1,346,210,598	0.750	2024/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	11,947.84	1,400,286,849	11,298.93	1,324,235,582	1.875	2032/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/31/25	10,900,000	12,149.74	1,324,322,379	12,057.55	1,314,273,754	0.250	2025/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	13,162.69	1,336,014,005	12,758.37	1,294,975,494	2.250	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	12,807.88	1,280,788,260	12,657.42	1,265,742,588	0.125	2024/1/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	12,000,000	11,282.15	1,353,858,480	10,543.68	1,265,242,662	0.625	2030/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,851.16	1,313,389,127	12,296.00	1,256,651,476	2.000	2026/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,221.44	1,340,962,528	10,481.74	1,252,568,513	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	12,104.72	1,349,677,185	11,214.44	1,250,410,722	1.625	2031/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	12,716.65	1,271,665,135	12,498.68	1,249,868,125	0.250	2024/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/29	9,800,000	12,584.29	1,233,261,304	12,469.91	1,222,051,404	2.875	2029/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	11,030,000	11,670.96	1,287,307,440	10,848.22	1,196,559,218	1.375	2031/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,425.67	1,273,963,031	10,654.09	1,187,932,079	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	12,011.94	1,226,419,254	11,368.65	1,160,739,962	1.125	2028/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	11,968.17	1,136,976,744	11,883.90	1,128,971,174	0.750	2026/4/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	12,685.29	1,141,676,156	12,461.87	1,121,568,993	0.250	2024/6/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	12,693.06	1,143,645,251	12,441.14	1,120,947,014	0.375	2024/7/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/30/27	9,880,000	11,245.56	1,111,061,337	11,214.18	1,107,961,639	0.375	2027/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,979.20	1,161,638,437	12,375.31	1,107,590,392	2.250	2027/2/15	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	97.43
合計	97.43

(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	69	アメリカドル	7,478,521.45	992,399,796	7,453,078.47	989,023,513	0.34
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	53	アメリカドル	6,006,046.96	797,002,431	5,959,187.5	790,784,181	0.27
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	47	アメリカドル	5,999,616.01	796,149,045	5,898,500	782,730,950	0.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	27	ユーロ	2,867,336.7	405,642,122	2,849,850	403,168,279	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	40	ユーロ	4,726,904	668,715,109	4,647,200	657,439,384	0.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	60	ユーロ	8,328,436	1,178,223,841	8,039,400	1,137,333,918	0.39

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

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

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	21,250,000.00	2,879,588,493	2,812,348,250	0.97
	カナダドル	買建	2,140,000.00	213,514,890	208,937,830	0.07
	ユーロ	買建	12,870,000.00	1,849,410,009	1,818,253,008	0.63
	イギリスポンド	買建	1,670,000.00	276,967,785	266,598,800	0.09
	オフショア人民元	買建	10,580,000.00	205,908,686	200,943,824	0.07

(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	20,046,082,847	17.98
	インド	15,742,343,976	14.12
	台湾	14,452,817,937	12.96
	中国	13,034,996,850	11.69
	韓国	12,299,250,052	11.03
	ブラジル	5,458,660,415	4.90
	サウジアラビア	4,397,417,899	3.94
	南アフリカ	3,907,695,463	3.50
	メキシコ	2,400,810,859	2.15
	タイ	2,391,479,686	2.14
	インドネシア	2,064,982,820	1.85
	マレーシア	1,716,236,642	1.54
	アラブ首長国連邦	1,473,709,244	1.32
	香港	1,227,666,974	1.10
	カタール	1,077,424,144	0.97
	クウェート	1,032,261,027	0.93
	フィリピン	785,641,112	0.70
	ポーランド	765,796,364	0.69
	トルコ	701,247,096	0.63
	バミューダ	602,804,237	0.54
	チリ	568,189,902	0.51
	アメリカ	496,134,883	0.44
	ギリシャ	394,774,178	0.35
	ハンガリー	192,494,130	0.17
	チェコ	159,560,846	0.14
	ルクセンブルク	123,370,395	0.11
	コロンビア	119,539,135	0.11
	エジプト	64,638,621	0.06
	オランダ	27,710,756	0.02
	シンガポール	25,985,625	0.02
ペルー	16,939,447	0.02	
ロシア	135	0.00	
	小計	107,768,663,697	96.65
投資信託受益証券	ブラジル	202,993,512	0.18

	メキシコ	53,387,551	0.05
	小計	256,381,063	0.23
投資証券	メキシコ	62,730,802	0.06
	南アフリカ	54,620,467	0.05
	小計	117,351,269	0.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,357,582,159	3.01
合計(純資産総額)		111,499,978,188	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,395,245,612	3.05

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

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

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		631,788,778	0.57
	売建		80,273	0.00

(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	3,172,389	1,803.84	5,722,499,807	1,924.80	6,106,221,326	5.48
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	801,500	4,045.69	3,242,622,702	5,705.10	4,572,640,856	4.10
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	610,572	6,538.05	3,991,953,924	5,834.15	3,562,168,634	3.19
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	1,908,888	1,132.40	2,161,633,844	1,456.06	2,779,457,370	2.49
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	571,200	2,468.73	1,410,138,870	3,128.27	1,786,871,251	1.60
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	396,254	4,190.25	1,660,406,068	4,093.50	1,622,067,928	1.45
ブラジル	株式	VALE SA	素材	504,687	1,847.07	932,194,179	2,229.48	1,125,191,438	1.01
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	443,828	2,431.63	1,079,229,851	2,443.17	1,084,349,474	0.97
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	12,669,620	75.86	961,201,232	83.05	1,052,308,230	0.94
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	283,411	2,960.32	838,987,561	3,710.36	1,051,556,838	0.94
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	679,237	1,466.83	996,325,381	1,459.78	991,541,343	0.89
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	各種金融	228,143	4,042.39	922,244,385	4,307.07	982,628,327	0.88
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	65,522	7,850.53	514,382,557	10,935.80	716,535,946	0.64
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	819,000	603.35	494,151,021	862.91	706,726,566	0.63
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	1,585,248	442.35	701,249,116	430.27	682,093,043	0.61
サウジア ラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	248,500	3,017.06	749,739,659	2,659.82	660,966,264	0.59
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	27,673	16,470.48	455,787,703	22,326.09	617,830,165	0.55
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	117,320	5,177.67	607,445,359	5,263.49	617,512,940	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	5,960.74	642,467,517	5,327.74	574,240,878	0.52
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	68,932	9,410.59	648,691,479	7,912.50	545,424,450	0.49
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半 導体製造装 置	196,804	2,805.20	552,075,564	2,714.57	534,239,277	0.48
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・ 娯楽	281,900	1,365.85	385,034,525	1,872.20	527,773,180	0.47
インドネ シア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	7,015,200	75.43	529,209,150	72.88	511,320,390	0.46
ケイマン	株式	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	490,500	767.85	376,634,141	1,013.54	497,141,860	0.45
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	10,228,200	44.93	459,581,665	48.33	494,398,458	0.44
サウジア ラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	276,263	2,023.16	558,925,356	1,786.18	493,456,827	0.44
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・ 娯楽	258,430	1,635.62	422,693,793	1,894.32	489,550,668	0.44
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	7,043,515	61.27	431,570,251	68.25	480,721,307	0.43
クウェー ト	株式	NATIONAL BANK OF KUWAIT	銀行	974,155	489.89	477,229,422	468.25	456,148,916	0.41

インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	288,046	1,407.70	405,483,362	1,505.34	433,610,046	0.39
-----	----	---------------	----	---------	----------	-------------	----------	-------------	------

(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	4.67
		素材	8.54
		資本財	3.77
		商業・専門サービス	0.08
		運輸	2.04
		自動車・自動車部品	2.98
		耐久消費財・アパレル	1.58
		消費者サービス	1.46
		メディア・娯楽	6.68
		小売	7.70
		食品・生活必需品小売り	1.41
		食品・飲料・タバコ	3.89
		家庭用品・パーソナル用品	0.87
		ヘルスケア機器・サービス	1.03
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.97
		銀行	15.48
		各種金融	3.17
		保険	2.65
		不動産	1.75
		ソフトウェア・サービス	2.47
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.47		
電気通信サービス	2.97		
公益事業	3.02		
半導体・半導体製造装置	8.01		
		小計	96.65
投資信託受益証券			0.23
投資証券			0.11
合計			96.99

(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	525	アメリカドル	25,599,300	3,397,027,110	25,585,875	3,395,245,612	3.05

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,840,606.12	379,922,001	376,658,278	0.34
	香港ドル	買建	15,000,000.00	258,060,000	255,130,500	0.23
	ブラジルレアル	売建	3,200.18	81,401	80,273	0.00

(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	8,621,235,326	10.06
	中国	8,544,344,747	9.97
	マレーシア	8,458,126,481	9.87
	インドネシア	8,393,589,314	9.79
	ブラジル	8,359,505,552	9.75
	メキシコ	8,178,832,610	9.54
	南アフリカ	8,140,109,432	9.49
	ポーランド	6,126,376,137	7.15
	チェコ	4,690,407,964	5.47
	コロンビア	3,027,536,792	3.53
	ルーマニア	2,838,405,181	3.31
	ハンガリー	2,571,610,210	3.00
	ペルー	1,964,964,532	2.29
	チリ	1,915,915,899	2.23
	ウルグアイ	124,468,702	0.15
	ドミニカ共和国	74,772,911	0.09
フィリピン	63,676,503	0.07	
	小計	82,093,878,293	95.75

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,641,173,010	4.25
合計(純資産総額)		85,735,051,303	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	2,183.27	2,272,789,627	2,213.84	2,304,616,720	0.000	2024/1/1	2.69
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	2.33	1,522,241,211	2.41	1,577,358,933	9.850	2027/6/28	1.84
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	173,400,000	824.23	1,429,224,646	826.51	1,433,177,617	10.500	2026/12/21	1.67
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	182,600,000	684.65	1,250,183,025	695.47	1,269,931,325	8.000	2030/1/31	1.48
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	53,300,000	2,312.71	1,232,679,007	2,353.33	1,254,329,066	0.000	2023/7/1	1.46
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	605.15	1,060,841,350	618.96	1,085,046,641	5.750	2026/3/5	1.27
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	158,100,000	607.84	961,008,295	632.03	999,240,986	7.750	2031/5/29	1.17
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	158,200,000	610.28	965,476,312	608.47	962,606,184	8.750	2048/2/28	1.12
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000	2,354.28	969,963,950	2,310.45	951,909,465	10.000	2027/1/1	1.11
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	656.55	843,015,572	659.65	847,002,503	8.000	2024/9/5	0.99
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	45,500,000	1,746.60	794,703,165	1,755.18	798,608,122	0.000	2026/1/1	0.93
タイ	国債証券	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000	409.21	736,591,104	423.05	761,503,265	3.775	2032/6/25	0.89
タイ	国債証券	THAIGB 1.45% 12/17/24	197,000,000	381.35	751,260,288	382.61	753,749,652	1.450	2024/12/17	0.88
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	112,000,000	658.99	738,070,368	665.59	745,471,216	8.250	2032/3/31	0.87
マレーシア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	27,300,000	2,611.20	712,858,012	2,710.72	740,028,219	2.632	2031/4/15	0.86
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000	629.82	717,999,241	644.09	734,268,341	7.500	2027/6/3	0.86
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	38,900,000	1,860.59	723,771,824	1,863.78	725,012,367	0.000	2025/7/1	0.85
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	110,000,000	655.34	720,882,008	657.38	723,127,130	8.875	2035/2/28	0.84
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	104,250,000	680.26	709,178,093	683.86	712,929,203	10.000	2024/12/5	0.83
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	113,700,000	619.76	704,674,260	618.52	703,260,537	8.500	2037/1/31	0.82
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	38,600,000,000	1.70	658,688,252	1.80	697,056,806	7.250	2034/10/18	0.81
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	23,000,000	3,003.75	690,864,576	3,020.74	694,771,377	3.955	2025/9/15	0.81
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	24,050,000	2,709.70	651,684,945	2,778.49	668,227,205	3.250	2025/7/25	0.78
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	27,800,000	2,416.11	671,678,620	2,398.30	666,728,074	10.000	2025/1/1	0.78
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	159,500,000	405.77	647,207,616	417.20	665,446,107	3.650	2031/6/20	0.78

メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	100,100,000	645.02	645,673,308	663.54	664,206,839	8.500	2029/5/31	0.77
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	30,850,000	2,068.17	638,030,578	2,091.09	645,103,107	0.000	2024/7/1	0.75
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000	609.17	598,820,719	645.40	634,437,786	8.500	2038/11/18	0.74
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	100,300,000	634.21	636,120,292	631.50	633,398,612	9.000	2040/1/31	0.74
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000	2,510.36	604,998,642	2,611.79	629,443,695	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	95.75
合計	95.75

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

#### 投資不動産物件


該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績



## 運用実績

当初設定日：2017年 8月25日

作成基準日：2022年12月30日

### 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	11,714円
純資産総額	45.84億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年 6月	0円
2019年 6月	0円
2020年 6月	0円
2021年 6月	0円
2022年 6月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	39.0%	T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.2%
		T 1.25% 09/30/28	アメリカ	国債	-	1.250%	2028/09/30	0.2%
新興国債券 インデックス マザーファンド	30.5%	BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.8%
		COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.6%
外国株式 インデックス マザーファンド	14.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ウェアラブル機器	-	-	0.6%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	0.5%
新興国株式 インデックス マザーファンド	9.5%	TAWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体/半導体製造装置	-	-	0.5%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア/娯楽	-	-	0.4%
国内債券 インデックス マザーファンド	4.1%	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	0.0%
国内株式 インデックス マザーファンド	1.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

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



#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

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

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

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、外国上場投資証券（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6月11日から翌年6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2018年6月11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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

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、本手続きに従います。

##### (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る他のファン

ドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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



### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2021年6月11日から2022年6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 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 （2021年 6月10日現在）	第5期 （2022年 6月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	26,614,607	45,846,847
親投資信託受益証券	2,365,420,702	3,990,341,136
未収入金	1,799,649	16,225,362
流動資産合計	2,393,834,958	4,052,413,345
資産合計	2,393,834,958	4,052,413,345
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,536,585	13,306,904
未払受託者報酬	537,434	998,505
未払委託者報酬	4,299,401	7,987,983
未払利息	29	52
その他未払費用	53,683	99,786
流動負債合計	6,427,132	22,393,230
負債合計	6,427,132	22,393,230
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,985,054,995	3,277,920,253
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	402,352,831	752,099,862
（分配準備積立金）	256,269,856	327,696,873
元本等合計	2,387,407,826	4,030,020,115
純資産合計	2,387,407,826	4,030,020,115
負債純資産合計	2,393,834,958	4,052,413,345

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2020年 6月11日	自	2021年 6月11日
	至	2021年 6月10日	至	2022年 6月10日
営業収益				
受取利息		83		197
有価証券売買等損益		238,302,121		110,246,509
営業収益合計		238,302,204		110,246,706
営業費用				
支払利息		6,422		13,911
受託者報酬		960,092		1,786,192
委託者報酬		7,680,594		14,289,415
その他費用		95,889		178,487
営業費用合計		8,742,997		16,268,005
営業利益又は営業損失（ ）		229,559,207		93,978,701
経常利益又は経常損失（ ）		229,559,207		93,978,701
当期純利益又は当期純損失（ ）		229,559,207		93,978,701
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（ ）		11,318,728		228,959
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		80,863,953		402,352,831
剰余金増加額又は欠損金減少額		119,057,057		308,162,613
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		119,057,057		308,162,613
剰余金減少額又は欠損金増加額		15,808,658		52,623,242
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		15,808,658		52,623,242
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		402,352,831		752,099,862

## (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4期 (2021年 6月10日現在)	第5期 (2022年 6月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,985,054,995口	3,277,920,253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) 1.2027円 (12,027円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2294円 (12,294円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2020年 6月11日 至 2021年 6月10日	第5期 自 2021年 6月11日 至 2022年 6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>45,993,890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>167,892,528円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>146,082,975円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>42,383,438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>402,352,831円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,985,054,995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>2,026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	45,993,890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	167,892,528円	収益調整金額	C	146,082,975円	分配準備積立金額	D	42,383,438円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	402,352,831円	当ファンドの期末残存口数	F	1,985,054,995口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,026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>77,562,783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>16,644,877円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>424,402,989円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>233,489,213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>752,099,862円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>3,277,920,253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>2,294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	77,562,783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	16,644,877円	収益調整金額	C	424,402,989円	分配準備積立金額	D	233,489,213円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	752,099,862円	当ファンドの期末残存口数	F	3,277,920,253口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,294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	45,993,890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	167,892,528円																																																											
収益調整金額	C	146,082,975円																																																											
分配準備積立金額	D	42,383,438円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	402,352,831円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,985,054,995口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,026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	77,562,783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	16,644,877円																																																											
収益調整金額	C	424,402,989円																																																											
分配準備積立金額	D	233,489,213円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	752,099,862円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,277,920,253口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,294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5期 自 2021年 6月11日 至 2022年 6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5期 (2022年 6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4期	第5期
	自 2020年 6月11日 至 2021年 6月10日	自 2021年 6月11日 至 2022年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,294,679,455円	1,985,054,995円
期中追加設定元本額	923,844,272円	1,555,340,467円
期中一部解約元本額	233,468,732円	262,475,209円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期	第5期
	(2021年 6月10日現在)	(2022年 6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	225,377,302	110,278,744
合計	225,377,302	110,278,744

（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	新興国株式インデックス マザーファンド	107,346,311	401,002,879	
	国内株式インデックス マザーファンド	31,841,021	61,096,551	
	外国株式インデックス マザーファンド	135,281,097	581,316,401	
	国内債券インデックス マザーファンド	115,290,275	158,927,644	

外国債券インデックス マザーファンド	504,887,461	1,591,354,788	
新興国債券インデックス マザーファンド	659,489,046	1,196,642,873	
合計	1,554,135,211	3,990,341,136	

(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 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,888,963,811
株式	497,588,133,070
未収入金	188,950
未収配当金	4,153,373,759
前払金	23,535,000
差入委託証拠金	200,462,500
流動資産合計	504,854,657,090
資産合計	504,854,657,090
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,538,850
未払金	821,524,130
未払解約金	191,161,606
未払利息	3,298
流動負債合計	1,036,227,884
負債合計	1,036,227,884
純資産の部	
元本等	
元本	262,569,150,387
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	241,249,278,819
元本等合計	503,818,429,206
純資産合計	503,818,429,206
負債純資産合計	504,854,657,090

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 6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 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	262,569,150,387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 1.9188円 (1万口当たり純資産額) (19,188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 6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。



	2022年 6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。</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 6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)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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月11日
期首元本額	249,370,614,913円
期中追加設定元本額	36,472,584,352円
期中一部解約元本額	23,274,048,878円
期末元本額	262,569,150,387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）	401,695,058円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,988,280,027円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,334,143円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,734,946,131円
世界経済インデックスファンド	3,882,434,141円
日本株式インデックス・オープン	3,305,664,228円
DCマイセレクション25	6,232,471,082円
DCマイセレクション50	18,992,541,920円
DCマイセレクション75	18,891,706,167円
DC日本株式インデックス・オープン	6,185,564,129円
DCマイセレクションS25	3,158,644,630円
DCマイセレクションS50	9,233,621,847円
DCマイセレクションS75	7,054,905,444円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,345,536,136円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	196,912,549円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	703,877,758円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	515,121,418円
DC世界経済インデックスファンド	3,607,599,527円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,780,937,800円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,350,367円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	19,058,334円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	21,158,127円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	186,379,544円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,336,253円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	31,325,672円

区分	2022年 6月10日現在
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	112,473,950円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	25,062,212円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	69,590,905円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	905,297,879円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	434,848,529円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,808,770,942円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	52,673,141円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	18,504,420円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	480,785,100円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	278,160,396円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	350,374,387円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	35,108,426円
F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	586,629,000円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,598,505,045円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,899,366,099円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,062,924,464円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンドA	1,418,670,019円
分散投資コア戦略ファンドS	6,097,040,794円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	480,442,891円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	419,348,096円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,814,770,815円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	220,849,792円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,222,684円
SMT インデックスバランス・オープン	57,975,226円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	30,211,570,530円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	558,843,487円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,078,621円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	177,124,795円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	31,841,021円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,744,572円
グローバル経済コア	218,225,235円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	27,807,164円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	101,233,170円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,501,895円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,218,279,892円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	196,685,950円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	14,022,326円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	11,583,242円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	4,982,161円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	5,629,730円
F O F s 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）	44,417,841,835円
F O F s 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）	938,399,055円

区分	2022年 6月10日現在
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	304,282,170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）	51,485,225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）	58,692,527円
S M T A M 日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	46,647,945,562円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,066,857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）	228,113,153円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 6月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	5,256,068,939	
合計	5,256,068,939	

(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 6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	6,179,675,000	-	6,156,140,000	23,535,000
合計		6,179,675,000	-	6,156,140,000	23,535,000

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	8,800	3,350.00	29,480,000	

日本水産	252,200	534.00	134,674,800
マルハニチロ	37,200	2,339.00	87,010,800
雪国まいたけ	19,300	889.00	17,157,700
カネコ種苗	7,500	1,701.00	12,757,500
サカタのタネ	29,700	4,580.00	136,026,000
ホクト	20,900	1,902.00	39,751,800
ホクリヨウ	3,600	635.00	2,286,000
住石ホールディングス	46,300	196.00	9,074,800
日鉄鉱業	5,400	5,750.00	31,050,000
三井松島ホールディングス	11,100	3,020.00	33,522,000
I N P E X	951,500	1,784.00	1,697,476,000
石油資源開発	31,100	3,650.00	113,515,000
K & O エナジーグループ	10,900	1,635.00	17,821,500
ショーボンドホールディングス	33,200	6,120.00	203,184,000
ミライト・ホールディングス	85,300	1,625.00	138,612,500
タマホーム	16,000	2,394.00	38,304,000
サンヨーホームズ	3,100	734.00	2,275,400
日本アクア	10,500	601.00	6,310,500
ファーストコーポレーション	6,500	758.00	4,927,000
ベステラ	5,300	1,178.00	6,243,400
Robot Home	44,100	197.00	8,687,700
キャンディル	4,100	543.00	2,226,300
ダイセキ環境ソリューション	5,100	994.00	5,069,400
第一カッター興業	6,100	1,320.00	8,052,000
安藤・間	124,200	822.00	102,092,400
東急建設	73,300	622.00	45,592,600
コムシスホールディングス	85,400	2,516.00	214,866,400
ビーアールホールディングス	34,200	316.00	10,807,200
高松コンストラクショングループ	16,200	2,059.00	33,355,800
東建コーポレーション	7,300	8,600.00	62,780,000
ソネック	2,700	1,016.00	2,743,200
ヤマウラ	11,900	930.00	11,067,000
オリエンタル白石	89,000	246.00	21,894,000
大成建設	166,100	4,135.00	686,823,500
大林組	582,400	975.00	567,840,000
清水建設	541,000	736.00	398,176,000
飛島建設	16,400	1,009.00	16,547,600
長谷工コーポレーション	170,000	1,592.00	270,640,000
松井建設	21,600	673.00	14,536,800
銭高組	2,400	3,565.00	8,556,000
鹿島建設	426,700	1,451.00	619,141,700
不動テトラ	13,000	1,610.00	20,930,000

大末建設	6,400	1,587.00	10,156,800
鉄建建設	12,600	1,819.00	22,919,400
西松建設	37,000	4,255.00	157,435,000
三井住友建設	137,900	450.00	62,055,000
大豊建設	8,900	4,460.00	39,694,000
佐田建設	13,200	453.00	5,979,600
ナカノフドー建設	14,600	314.00	4,584,400
奥村組	32,000	2,950.00	94,400,000
東鉄工業	25,500	2,297.00	58,573,500
イチケン	4,400	1,838.00	8,087,200
富士ピー・エス	7,900	478.00	3,776,200
浅沼組	6,800	5,380.00	36,584,000
戸田建設	240,900	723.00	174,170,700
熊谷組	30,200	2,714.00	81,962,800
北野建設	3,700	2,103.00	7,781,100
植木組	5,100	1,449.00	7,389,900
矢作建設工業	25,200	768.00	19,353,600
ピーエス三菱	20,100	607.00	12,200,700
日本ハウスホールディングス	41,400	401.00	16,601,400
大東建託	62,600	11,410.00	714,266,000
新日本建設	26,000	746.00	19,396,000
東亜道路工業	3,200	5,550.00	17,760,000
日本道路	5,300	6,690.00	35,457,000
東亜建設工業	14,100	2,400.00	33,840,000
日本国土開発	51,600	514.00	26,522,400
若築建設	9,700	2,149.00	20,845,300
東洋建設	68,600	824.00	56,526,400
五洋建設	230,900	651.00	150,315,900
世紀東急工業	29,400	809.00	23,784,600
福田組	6,500	4,515.00	29,347,500
住友林業	141,500	2,009.00	284,273,500
日本基礎技術	15,600	604.00	9,422,400
巴コーポレーション	23,900	417.00	9,966,300
大和ハウス工業	510,900	3,137.00	1,602,693,300
ライト工業	34,700	1,782.00	61,835,400
積水ハウス	608,000	2,373.50	1,443,088,000
日特建設	12,600	789.00	9,941,400
北陸電気工事	11,500	769.00	8,843,500
ユアテック	35,000	709.00	24,815,000
日本リーテック	12,000	1,104.00	13,248,000
四電工	6,200	1,740.00	10,788,000
中電工	25,800	2,091.00	53,947,800

関電工	99,400	835.00	82,999,000
きんでん	128,300	1,523.00	195,400,900
東京エネシス	18,800	996.00	18,724,800
トーエネック	6,100	3,365.00	20,526,500
住友電設	15,100	2,489.00	37,583,900
日本電設工業	28,600	1,613.00	46,131,800
エクシオグループ	87,200	2,120.00	184,864,000
新日本空調	14,200	1,885.00	26,767,000
九電工	41,500	2,747.00	114,000,500
三機工業	39,700	1,511.00	59,986,700
日揮ホールディングス	177,900	2,011.00	357,756,900
中外炉工業	5,800	1,754.00	10,173,200
ヤマト	15,800	750.00	11,850,000
太平電業	11,900	2,789.00	33,189,100
高砂熱学工業	49,600	1,621.00	80,401,600
三晃金属工業	2,400	2,633.00	6,319,200
朝日工業社	7,700	1,621.00	12,481,700
明星工業	33,000	743.00	24,519,000
大気社	26,900	3,185.00	85,676,500
ダイダン	12,200	2,068.00	25,229,600
日比谷総合設備	17,700	1,888.00	33,417,600
フィル・カンパニー	3,300	1,217.00	4,016,100
テスホールディングス	17,000	1,350.00	22,950,000
インフロニア・ホールディングス	237,300	927.00	219,977,100
東洋エンジニアリング	25,700	664.00	17,064,800
レイズネクスト	27,300	1,174.00	32,050,200
ニッポン	50,900	1,555.00	79,149,500
日清製粉グループ本社	196,600	1,497.00	294,310,200
日東富士製粉	2,800	4,380.00	12,264,000
昭和産業	16,500	2,438.00	40,227,000
鳥越製粉	15,200	646.00	9,819,200
中部飼料	20,800	1,016.00	21,132,800
フィード・ワン	24,100	663.00	15,978,300
東洋精糖	3,300	960.00	3,168,000
日本甜菜製糖	10,200	1,649.00	16,819,800
D M三井製糖ホールディングス	16,500	1,871.00	30,871,500
塩水港精糖	23,300	210.00	4,893,000
日新製糖	9,300	1,723.00	16,023,900
森永製菓	41,600	3,855.00	160,368,000
中村屋	4,200	3,060.00	12,852,000
江崎グリコ	48,400	3,660.00	177,144,000
名糖産業	7,600	1,619.00	12,304,400

井村屋グループ	10,000	2,299.00	22,990,000
不二家	10,900	2,317.00	25,255,300
山崎製パン	128,900	1,483.00	191,158,700
第一屋製パン	3,800	514.00	1,953,200
モロゾフ	5,900	3,395.00	20,030,500
亀田製菓	10,500	4,335.00	45,517,500
寿スピリッツ	17,600	7,520.00	132,352,000
カルビー	89,200	2,413.00	215,239,600
森永乳業	34,200	4,415.00	150,993,000
六甲バター	13,400	1,406.00	18,840,400
ヤクルト本社	131,200	7,420.00	973,504,000
明治ホールディングス	113,800	6,230.00	708,974,000
雪印メグミルク	44,300	1,711.00	75,797,300
プリマハム	24,500	2,115.00	51,817,500
日本ハム	70,600	4,020.00	283,812,000
林兼産業	5,900	493.00	2,908,700
丸大食品	18,200	1,483.00	26,990,600
S Foods	17,600	3,025.00	53,240,000
柿安本店	6,800	2,432.00	16,537,600
伊藤ハム米久ホールディングス	126,000	661.00	83,286,000
サッポロホールディングス	60,400	2,843.00	171,717,200
アサヒグループホールディングス	419,500	4,431.00	1,858,804,500
キリンホールディングス	719,300	2,078.50	1,495,065,050
宝ホールディングス	116,900	968.00	113,159,200
オエノンホールディングス	52,900	296.00	15,658,400
養命酒製造	5,500	1,748.00	9,614,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,000	1,466.00	189,114,000
サントリー食品インターナショナル	130,900	4,850.00	634,865,000
ダイドーグループホールディングス	10,000	4,990.00	49,900,000
伊藤園	59,400	5,310.00	315,414,000
キーコーヒー	18,300	2,075.00	37,972,500
ユニカフェ	5,900	918.00	5,416,200
ジャパンフーズ	2,800	1,160.00	3,248,000
日清オイリオグループ	23,100	2,986.00	68,976,600
不二製油グループ本社	42,400	1,827.00	77,464,800
かどや製油	1,800	3,450.00	6,210,000
J - オイルミルズ	18,300	1,511.00	27,651,300
キッコーマン	125,200	6,870.00	860,124,000
味の素	401,000	2,993.50	1,200,393,500
ブルドックソース	7,400	1,839.00	13,608,600
キューピー	91,400	2,141.00	195,687,400
ハウス食品グループ本社	65,100	2,720.00	177,072,000



カゴメ	74,300	3,275.00	243,332,500
焼津水産化学工業	8,400	915.00	7,686,000
アリアケジャパン	17,900	5,330.00	95,407,000
ピエトロ	2,600	1,800.00	4,680,000
エバラ食品工業	4,300	2,987.00	12,844,100
やまみ	1,700	1,636.00	2,781,200
ニチレイ	78,400	2,262.00	177,340,800
東洋水産	89,500	4,760.00	426,020,000
イトアンドホールディングス	7,400	2,285.00	16,909,000
大冷	2,200	1,900.00	4,180,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,100	542.00	5,474,200
日清食品ホールディングス	67,300	8,320.00	559,936,000
永谷園ホールディングス	8,700	1,988.00	17,295,600
一正蒲鉾	7,900	834.00	6,588,600
フジッコ	18,200	1,917.00	34,889,400
ロック・フィールド	20,000	1,391.00	27,820,000
日本たばこ産業	1,049,300	2,383.00	2,500,481,900
ケンコーマヨネーズ	10,300	1,394.00	14,358,200
わらべや日洋ホールディングス	12,100	1,727.00	20,896,700
なとり	10,900	1,978.00	21,560,200
イフジ産業	3,400	986.00	3,352,400
ピクルスコーポレーション	9,300	1,313.00	12,210,900
ファーマフーズ	24,600	1,612.00	39,655,200
ユーグレナ	100,500	922.00	92,661,000
紀文食品	15,200	958.00	14,561,600
ミヨシ油脂	7,100	1,044.00	7,412,400
理研ビタミン	17,900	1,595.00	28,550,500
片倉工業	18,700	2,136.00	39,943,200
ゲンゼ	11,600	3,725.00	43,210,000
東洋紡	75,900	1,052.00	79,846,800
ユニチカ	54,500	239.00	13,025,500
富士紡ホールディングス	8,200	3,380.00	27,716,000
倉敷紡績	14,900	2,042.00	30,425,800
シキボウ	10,000	895.00	8,950,000
日本毛織	51,100	960.00	49,056,000
トーア紡コーポレーション	7,000	376.00	2,632,000
帝国繊維	20,800	1,607.00	33,425,600
帝人	172,100	1,376.00	236,809,600
東レ	1,251,900	727.30	910,506,870
住江織物	3,400	1,719.00	5,844,600
日本フェルト	12,000	421.00	5,052,000
イチカワ	2,700	1,383.00	3,734,100

日東製網	2,100	1,369.00	2,874,900
アツギ	14,400	534.00	7,689,600
ダイニック	6,500	685.00	4,452,500
セーレン	36,800	2,003.00	73,710,400
ソトー	7,200	830.00	5,976,000
東海染工	2,400	1,138.00	2,731,200
小松マテーレ	29,800	1,317.00	39,246,600
ワコールホールディングス	42,500	2,142.00	91,035,000
ホギメディカル	24,500	2,955.00	72,397,500
T S Iホールディングス	60,500	373.00	22,566,500
マツオカコーポレーション	5,900	1,004.00	5,923,600
ワールド	25,100	1,375.00	34,512,500
三陽商会	8,700	915.00	7,960,500
ナイガイ	7,200	311.00	2,239,200
オンワードホールディングス	109,200	264.00	28,828,800
ルックホールディングス	6,200	1,570.00	9,734,000
ゴールドウイン	32,600	8,390.00	273,514,000
デサント	34,200	3,100.00	106,020,000
キング	9,400	540.00	5,076,000
ヤマトインターナショナル	15,800	285.00	4,503,000
特種東海製紙	10,500	3,125.00	32,812,500
王子ホールディングス	757,400	562.00	425,658,800
日本製紙	82,100	954.00	78,323,400
三菱製紙	25,300	306.00	7,741,800
北越コーポレーション	117,600	665.00	78,204,000
中越パルプ工業	7,300	917.00	6,694,100
巴川製紙所	5,700	631.00	3,596,700
大王製紙	85,300	1,439.00	122,746,700
阿波製紙	4,500	319.00	1,435,500
レンゴー	158,600	706.00	111,971,600
トーモク	10,100	1,540.00	15,554,000
ザ・パック	12,900	2,244.00	28,947,600
北の達人コーポレーション	68,300	221.00	15,094,300
クラレ	265,000	1,150.00	304,750,000
旭化成	1,209,600	1,088.00	1,316,044,800
共和レザー	10,900	596.00	6,496,400
昭和電工	167,100	2,643.00	441,645,300
住友化学	1,336,300	565.00	755,009,500
住友精化	7,900	3,005.00	23,739,500
日産化学	92,400	7,520.00	694,848,000
ラサ工業	6,700	2,074.00	13,895,800
クレハ	14,300	10,730.00	153,439,000

多木化学	6,700	4,810.00	32,227,000	
テイカ	11,900	1,306.00	15,541,400	
石原産業	33,400	1,199.00	40,046,600	
片倉コープアグリ	4,300	1,428.00	6,140,400	
日本曹達	22,100	4,365.00	96,466,500	
東ソー	249,300	1,795.00	447,493,500	
トクヤマ	58,200	1,811.00	105,400,200	
セントラル硝子	29,500	3,035.00	89,532,500	
東亜合成	96,000	1,056.00	101,376,000	
大阪ソーダ	15,600	3,070.00	47,892,000	
関東電化工業	37,200	925.00	34,410,000	
デンカ	66,100	3,315.00	219,121,500	
信越化学工業	311,100	18,115.00	5,635,576,500	
日本カーバイド工業	6,800	1,445.00	9,826,000	
堺化学工業	12,700	1,964.00	24,942,800	
第一稀元素化学工業	16,700	1,158.00	19,338,600	
エア・ウォーター	162,300	1,724.00	279,805,200	
日本酸素ホールディングス	166,100	2,458.00	408,273,800	
日本化学工業	5,600	2,112.00	11,827,200	
東邦アセチレン	4,000	1,168.00	4,672,000	
日本パーカライズン	85,600	920.00	78,752,000	
高压ガス工業	28,000	665.00	18,620,000	
チタン工業	2,200	1,721.00	3,786,200	
四国化成工業	22,900	1,289.00	29,518,100	
戸田工業	4,100	2,703.00	11,082,300	
ステラ ケミファ	9,600	2,567.00	24,643,200	
保土谷化学工業	5,400	3,885.00	20,979,000	
日本触媒	28,800	5,550.00	159,840,000	
大日精化工業	14,300	1,850.00	26,455,000	
カネカ	43,900	3,415.00	149,918,500	
三菱瓦斯化学	159,500	2,173.00	346,593,500	
三井化学	157,000	3,220.00	505,540,000	
J S R	178,000	4,160.00	740,480,000	
東京応化工業	29,200	7,470.00	218,124,000	
大阪有機化学工業	14,500	2,603.00	37,743,500	
三菱ケミカルホールディングス	1,215,900	786.90	956,791,710	
K Hネオケム	30,000	2,610.00	78,300,000	
ダイセル	262,900	903.00	237,398,700	
住友ベークライト	28,000	4,675.00	130,900,000	
積水化学工業	380,600	1,835.00	698,401,000	
日本ゼオン	153,100	1,395.00	213,574,500	
アイカ工業	47,700	2,805.00	133,798,500	

U B E	90,000	2,097.00	188,730,000
積水樹脂	27,100	1,699.00	46,042,900
タキロンシーアイ	41,300	536.00	22,136,800
旭有機材	10,800	2,230.00	24,084,000
ニチバン	10,500	1,611.00	16,915,500
リケンテクノス	41,400	442.00	18,298,800
大倉工業	8,800	1,757.00	15,461,600
積水化成成品工業	23,700	412.00	9,764,400
群栄化学工業	4,000	2,805.00	11,220,000
タイガースポリマー	9,400	437.00	4,107,800
ミライアル	6,100	2,216.00	13,517,600
ダイキアクシス	7,400	762.00	5,638,800
ダイキョーニシカワ	40,300	515.00	20,754,500
竹本容器	6,800	820.00	5,576,000
森六ホールディングス	9,600	1,839.00	17,654,400
恵和	5,200	4,350.00	22,620,000
日本化薬	137,600	1,140.00	156,864,000
カーリットホールディングス	17,000	736.00	12,512,000
日本精化	13,300	2,000.00	26,600,000
扶桑化学工業	15,800	3,880.00	61,304,000
トリケミカル研究所	19,700	2,579.00	50,806,300
A D E K A	79,600	2,575.00	204,970,000
日油	58,500	5,130.00	300,105,000
新日本理化	28,600	257.00	7,350,200
ハリマ化成グループ	13,200	768.00	10,137,600
花王	412,200	5,265.00	2,170,233,000
第一工業製薬	6,700	2,233.00	14,961,100
石原ケミカル	9,100	1,325.00	12,057,500
日華化学	6,400	891.00	5,702,400
ニイタカ	3,700	2,207.00	8,165,900
三洋化成工業	11,400	4,765.00	54,321,000
有機合成薬品工業	13,300	282.00	3,750,600
大日本塗料	22,200	752.00	16,694,400
日本ペイントホールディングス	717,500	990.00	710,325,000
関西ペイント	176,100	1,745.00	307,294,500
神東塗料	15,000	156.00	2,340,000
中国塗料	42,500	867.00	36,847,500
日本特殊塗料	12,400	938.00	11,631,200
藤倉化成	23,800	490.00	11,662,000
太陽ホールディングス	28,100	3,095.00	86,969,500
D I C	73,000	2,554.00	186,442,000
サカティンクス	37,900	922.00	34,943,800

東洋インキＳＣホールディングス	37,900	1,975.00	74,852,500
T & K T O K A	15,400	829.00	12,766,600
富士フイルムホールディングス	342,700	7,315.00	2,506,850,500
資生堂	363,200	5,500.00	1,997,600,000
ライオン	206,600	1,412.00	291,719,200
高砂香料工業	11,800	2,383.00	28,119,400
マンダム	39,000	1,472.00	57,408,000
ミルボン	24,100	5,060.00	121,946,000
ファンケル	78,900	2,321.00	183,126,900
コーセー	36,700	12,100.00	444,070,000
コタ	13,600	1,428.00	19,420,800
シーボン	2,500	1,712.00	4,280,000
ポーラ・オルビスホールディングス	83,200	1,587.00	132,038,400
ノエビアホールディングス	15,200	5,650.00	85,880,000
アジュバンホールディングス	4,400	989.00	4,351,600
新日本製薬	7,900	1,446.00	11,423,400
エステー	12,500	1,470.00	18,375,000
アグロ カネショウ	6,500	1,314.00	8,541,000
コニシ	30,400	1,578.00	47,971,200
長谷川香料	33,600	2,519.00	84,638,400
星光P M C	11,000	576.00	6,336,000
小林製薬	54,600	8,340.00	455,364,000
荒川化学工業	14,600	1,011.00	14,760,600
メック	13,800	2,596.00	35,824,800
日本高純度化学	4,800	2,332.00	11,193,600
タカラバイオ	51,000	1,912.00	97,512,000
J C U	20,600	3,570.00	73,542,000
新田ゼラチン	11,500	625.00	7,187,500
O A T アグリオ	8,000	1,853.00	14,824,000
デクセリアルズ	50,800	4,125.00	209,550,000
アース製薬	16,000	5,210.00	83,360,000
北興化学工業	16,900	1,100.00	18,590,000
大成ラミック	5,400	2,667.00	14,401,800
クミアイ化学工業	72,600	1,107.00	80,368,200
日本農薬	34,700	790.00	27,413,000
アキレス	12,500	1,371.00	17,137,500
有沢製作所	27,100	1,098.00	29,755,800
日東電工	117,900	9,750.00	1,149,525,000
レック	23,900	701.00	16,753,900
三光合成	22,300	350.00	7,805,000
きもと	29,800	231.00	6,883,800
藤森工業	15,900	3,670.00	58,353,000

前澤化成工業	11,700	1,302.00	15,233,400
未来工業	7,000	1,529.00	10,703,000
ウェブロックホールディングス	7,400	665.00	4,921,000
J S P	11,400	1,429.00	16,290,600
エフピコ	35,800	2,709.00	96,982,200
天馬	15,300	2,408.00	36,842,400
信越ポリマー	35,000	1,156.00	40,460,000
東リ	45,900	216.00	9,914,400
ニフコ	65,100	3,210.00	208,971,000
バルカー	15,800	2,867.00	45,298,600
ユニ・チャーム	375,800	4,205.00	1,580,239,000
ショーエイコーポレーション	5,200	581.00	3,021,200
協和キリン	207,100	2,940.00	608,874,000
武田薬品工業	1,532,600	3,632.00	5,566,403,200
アステラス製薬	1,667,100	2,077.50	3,463,400,250
住友ファーマ	120,400	1,084.00	130,513,600
塩野義製薬	232,700	7,002.00	1,629,365,400
わかもと製薬	20,400	267.00	5,446,800
日本新薬	45,400	7,600.00	345,040,000
中外製薬	609,900	3,608.00	2,200,519,200
科研製薬	28,700	3,725.00	106,907,500
エーザイ	221,400	5,395.00	1,194,453,000
ロート製薬	95,300	3,340.00	318,302,000
小野薬品工業	396,800	3,331.00	1,321,740,800
久光製薬	44,700	3,340.00	149,298,000
持田製薬	22,700	3,145.00	71,391,500
参天製薬	347,700	1,008.00	350,481,600
扶桑薬品工業	6,500	2,127.00	13,825,500
日本ケミファ	2,200	1,910.00	4,202,000
ツムラ	57,300	2,886.00	165,367,800
日医工	57,200	372.00	21,278,400
キッセイ薬品工業	30,300	2,460.00	74,538,000
生化学工業	34,400	817.00	28,104,800
栄研化学	30,800	1,620.00	49,896,000
日水製薬	7,200	1,711.00	12,319,200
鳥居薬品	10,500	2,944.00	30,912,000
J C R ファーマ	55,000	2,401.00	132,055,000
東和薬品	28,100	2,441.00	68,592,100
富士製薬工業	11,000	945.00	10,395,000
ゼリア新薬工業	31,100	2,082.00	64,750,200
第一三共	1,453,800	3,370.00	4,899,306,000
キョーリン製薬ホールディングス	36,500	1,686.00	61,539,000

大幸薬品	29,400	585.00	17,199,000
ダイト	12,300	2,720.00	33,456,000
大塚ホールディングス	382,800	4,436.00	1,698,100,800
大正製薬ホールディングス	39,500	4,830.00	190,785,000
ペプチドリーム	102,300	1,485.00	151,915,500
あすか製薬ホールディングス	19,700	997.00	19,640,900
サワイグループホールディングス	39,200	3,950.00	154,840,000
日本コークス工業	164,700	131.00	21,575,700
ニチレキ	22,400	1,311.00	29,366,400
ユシロ化学工業	9,500	1,009.00	9,585,500
ビーピー・カストロール	7,000	1,222.00	8,554,000
富士石油	45,800	354.00	16,213,200
MORESCO	6,500	1,271.00	8,261,500
出光興産	204,400	3,915.00	800,226,000
Eneosホールディングス	2,933,400	569.30	1,669,984,620
コスモエネルギーホールディングス	70,100	4,005.00	280,750,500
横浜ゴム	99,200	1,806.00	179,155,200
TOYO TIRE	96,400	1,841.00	177,472,400
ブリヂストン	532,900	5,253.00	2,799,323,700
住友ゴム工業	164,600	1,258.00	207,066,800
藤倉コンポジット	15,600	891.00	13,899,600
オカモト	10,000	3,875.00	38,750,000
フコク	8,500	975.00	8,287,500
ニッタ	18,900	2,932.00	55,414,800
住友理工	37,800	587.00	22,188,600
三ツ星ベルト	23,700	2,863.00	67,853,100
バンドー化学	31,400	905.00	28,417,000
日東紡績	25,800	2,598.00	67,028,400
AGC	169,900	5,150.00	874,985,000
日本板硝子	90,000	427.00	38,430,000
石塚硝子	3,200	1,714.00	5,484,800
日本山村硝子	7,100	748.00	5,310,800
日本電気硝子	74,400	2,831.00	210,626,400
オハラ	7,800	1,324.00	10,327,200
住友大阪セメント	33,100	3,455.00	114,360,500
太平洋セメント	110,800	2,082.00	230,685,600
日本ヒューム	17,400	697.00	12,127,800
日本コンクリート工業	36,600	290.00	10,614,000
三谷セキサン	8,300	4,680.00	38,844,000
アジアパイルホールディングス	28,700	466.00	13,374,200
東海カーボン	154,500	1,209.00	186,790,500
日本カーボン	10,100	4,360.00	44,036,000

東洋炭素	11,900	2,862.00	34,057,800
ノリタケカンパニーリミテド	10,200	4,255.00	43,401,000
TOTO	125,000	4,420.00	552,500,000
日本碍子	198,500	1,951.00	387,273,500
日本特殊陶業	140,100	2,647.00	370,844,700
MARUWA	6,700	14,720.00	98,624,000
品川リフラクトリーズ	4,600	3,590.00	16,514,000
黒崎播磨	3,300	4,315.00	14,239,500
ヨータイ	12,500	1,468.00	18,350,000
東京窯業	21,600	282.00	6,091,200
ニッカトー	8,600	486.00	4,179,600
フジインコーポレーテッド	15,700	5,970.00	93,729,000
クニミネ工業	6,300	950.00	5,985,000
エーアンドエーマテリアル	3,300	890.00	2,937,000
ニチアス	42,500	2,360.00	100,300,000
ニチハ	25,700	2,507.00	64,429,900
日本製鉄	824,700	2,150.00	1,773,105,000
神戸製鋼所	344,000	703.00	241,832,000
中山製鋼所	28,200	440.00	12,408,000
合同製鐵	9,700	1,362.00	13,211,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	471,300	1,623.00	764,919,900
東京製鐵	59,500	1,621.00	96,449,500
共英製鋼	20,000	1,368.00	27,360,000
大和工業	32,800	4,600.00	150,880,000
東京鐵鋼	8,200	1,250.00	10,250,000
大阪製鐵	10,300	1,473.00	15,171,900
淀川製鋼所	22,500	2,251.00	50,647,500
丸一鋼管	57,700	3,025.00	174,542,500
モリ工業	5,000	2,452.00	12,260,000
大同特殊鋼	28,100	3,655.00	102,705,500
日本高周波鋼業	7,300	341.00	2,489,300
日本冶金工業	13,500	2,219.00	29,956,500
山陽特殊製鋼	17,600	2,158.00	37,980,800
愛知製鋼	10,900	2,092.00	22,802,800
日立金属	207,800	2,024.00	420,587,200
日本金属	4,900	1,172.00	5,742,800
大平洋金属	11,900	2,775.00	33,022,500
新日本電工	112,800	379.00	42,751,200
栗本鐵工所	8,200	1,635.00	13,407,000
虹技	2,600	977.00	2,540,200
三菱製鋼	12,400	997.00	12,362,800
日亜鋼業	23,200	265.00	6,148,000



日本精線	3,000	4,245.00	12,735,000
エンビプロ・ホールディングス	12,800	920.00	11,776,000
シンニッタン	23,600	226.00	5,333,600
新家工業	4,300	1,545.00	6,643,500
大紀アルミニウム工業所	25,600	1,337.00	34,227,200
日本軽金属ホールディングス	48,900	1,589.00	77,702,100
三井金属鉱業	52,100	3,425.00	178,442,500
東邦亜鉛	10,200	2,396.00	24,439,200
三菱マテリアル	116,800	2,030.00	237,104,000
住友金属鉱山	223,000	5,311.00	1,184,353,000
DOWAホールディングス	47,600	4,725.00	224,910,000
古河機械金属	30,300	1,244.00	37,693,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	22,300	2,838.00	63,287,400
東邦チタニウム	34,600	2,817.00	97,468,200
UACJ	27,400	2,288.00	62,691,200
CKサンエツ	3,800	4,030.00	15,314,000
古河電気工業	57,100	2,268.00	129,502,800
住友電気工業	689,000	1,520.00	1,047,280,000
フジクラ	215,100	835.00	179,608,500
昭和電線ホールディングス	16,900	1,750.00	29,575,000
東京特殊電線	2,700	2,390.00	6,453,000
タツタ電線	34,200	499.00	17,065,800
カナレ電気	2,900	1,659.00	4,811,100
平河ヒューテック	10,800	1,132.00	12,225,600
リョービ	21,200	1,116.00	23,659,200
アーレスティ	20,800	388.00	8,070,400
アサヒホールディングス	77,300	2,126.00	164,339,800
稲葉製作所	10,100	1,321.00	13,342,100
宮地エンジニアリンググループ	5,600	3,395.00	19,012,000
トーカロ	49,700	1,350.00	67,095,000
アルファC o	7,000	998.00	6,986,000
SUMCO	310,900	2,093.00	650,713,700
川田テクノロジーズ	3,700	3,505.00	12,968,500
RS Technologies	6,300	6,290.00	39,627,000
ジェイテックコーポレーション	2,500	2,257.00	5,642,500
信和	12,000	787.00	9,444,000
東洋製罐グループホールディングス	106,500	1,408.00	149,952,000
ホッカンホールディングス	9,500	1,257.00	11,941,500
コロナ	9,800	837.00	8,202,600
横河ブリッジホールディングス	29,400	2,018.00	59,329,200
駒井ハルテック	3,200	1,736.00	5,555,200
高田機工	1,700	2,506.00	4,260,200

三和ホールディングス	181,800	1,284.00	233,431,200
文化シャッター	58,300	987.00	57,542,100
三協立山	23,600	593.00	13,994,800
アルインコ	13,200	855.00	11,286,000
東洋シャッター	4,300	648.00	2,786,400
LIXIL	303,500	2,551.00	774,228,500
日本フィルコン	12,500	500.00	6,250,000
ノーリツ	32,800	1,507.00	49,429,600
長府製作所	19,600	1,781.00	34,907,600
リンナイ	34,300	9,060.00	310,758,000
ダイニチ工業	9,200	641.00	5,897,200
日東精工	22,600	503.00	11,367,800
三洋工業	2,300	1,738.00	3,997,400
岡部	31,800	637.00	20,256,600
ジーテクト	22,200	1,334.00	29,614,800
東プレ	31,600	1,070.00	33,812,000
高周波熱錬	30,500	694.00	21,167,000
東京製網	11,800	933.00	11,009,400
サンコール	16,500	653.00	10,774,500
モリテック スチール	15,000	307.00	4,605,000
パイオラックス	26,100	2,070.00	54,027,000
エイチワン	17,800	624.00	11,107,200
日本発條	167,500	966.00	161,805,000
中央発條	9,300	712.00	6,621,600
アドバネクス	2,500	1,463.00	3,657,500
立川ブラインド工業	7,900	1,099.00	8,682,100
三益半導体工業	15,000	2,423.00	36,345,000
日本ドライケミカル	4,600	1,606.00	7,387,600
日本製鋼所	52,600	3,310.00	174,106,000
三浦工業	78,500	2,829.00	222,076,500
タクマ	58,900	1,420.00	83,638,000
ツガミ	40,600	1,244.00	50,506,400
オークマ	19,800	5,560.00	110,088,000
芝浦機械	21,900	3,090.00	67,671,000
アマダ	304,700	1,071.00	326,333,700
アイダエンジニアリング	45,200	905.00	40,906,000
滝澤鉄工所	5,700	1,256.00	7,159,200
F U J I	81,000	2,164.00	175,284,000
牧野フライス製作所	20,200	4,575.00	92,415,000
オーエスジー	86,300	1,670.00	144,121,000
ダイジェット工業	2,400	930.00	2,232,000
旭ダイヤモンド工業	48,900	603.00	29,486,700

DMG森精機	109,500	1,927.00	211,006,500
ソディック	42,100	832.00	35,027,200
ディスコ	28,400	33,300.00	945,720,000
日東工器	9,800	1,551.00	15,199,800
日進工具	15,200	1,286.00	19,547,200
パンチ工業	16,500	479.00	7,903,500
富士ダイス	9,900	678.00	6,712,200
豊和工業	10,200	1,043.00	10,638,600
OKK	7,100	1,178.00	8,363,800
東洋機械金属	12,700	606.00	7,696,200
津田駒工業	3,400	566.00	1,924,400
エンシュウ	4,600	839.00	3,859,400
島精機製作所	28,300	2,235.00	63,250,500
オプトラン	24,200	2,028.00	49,077,600
NCホールディングス	5,000	1,993.00	9,965,000
イワキポンプ	12,400	948.00	11,755,200
フリー	17,200	1,122.00	19,298,400
ヤマシンフィルタ	33,500	347.00	11,624,500
日阪製作所	21,300	840.00	17,892,000
やまびこ	33,900	1,197.00	40,578,300
野村マイクロ・サイエンス	6,400	4,000.00	25,600,000
平田機工	8,700	4,320.00	37,584,000
ペガサスミシン製造	19,700	611.00	12,036,700
マルマエ	8,000	2,031.00	16,248,000
タツモ	9,100	1,270.00	11,557,000
ナプテスコ	105,200	3,320.00	349,264,000
三井海洋開発	20,600	1,347.00	27,748,200
レオン自動機	20,700	1,300.00	26,910,000
S M C	57,100	69,600.00	3,974,160,000
ホソカワミクロン	12,900	2,672.00	34,468,800
ユニオンツール	7,200	3,650.00	26,280,000
オイレス工業	25,700	1,574.00	40,451,800
日精エー・エス・ビー機械	7,200	3,410.00	24,552,000
サトーホールディングス	25,400	1,889.00	47,980,600
技研製作所	17,100	3,340.00	57,114,000
日本エアーテック	9,000	1,041.00	9,369,000
カワタ	5,900	1,065.00	6,283,500
日精樹脂工業	12,900	915.00	11,803,500
オカダアイヨン	6,200	1,525.00	9,455,000
ワイエイシイホールディングス	7,700	1,744.00	13,428,800
小松製作所	883,800	3,469.00	3,065,902,200
住友重機械工業	106,800	3,250.00	347,100,000

日立建機	78,200	3,355.00	262,361,000
日工	25,600	611.00	15,641,600
巴工業	7,300	2,361.00	17,235,300
井関農機	16,500	1,258.00	20,757,000
TOWA	16,700	1,811.00	30,243,700
丸山製作所	3,600	1,585.00	5,706,000
北川鉄工所	8,200	1,516.00	12,431,200
ローツェ	9,600	10,180.00	97,728,000
タカキタ	6,400	563.00	3,603,200
クボタ	944,700	2,452.00	2,316,404,400
荏原実業	9,100	2,412.00	21,949,200
三菱化工機	6,100	2,127.00	12,974,700
月島機械	32,600	910.00	29,666,000
帝国電機製作所	12,900	1,563.00	20,162,700
新東工業	39,000	699.00	27,261,000
澁谷工業	16,000	2,334.00	37,344,000
アイチ コーポレーション	28,100	871.00	24,475,100
小森コーポレーション	47,500	797.00	37,857,500
鶴見製作所	14,300	1,826.00	26,111,800
住友精密工業	2,900	2,946.00	8,543,400
日本ギア工業	7,300	273.00	1,992,900
酒井重工業	3,400	3,035.00	10,319,000
荏原製作所	78,100	5,680.00	443,608,000
石井鐵工所	2,600	2,862.00	7,441,200
西島製作所	16,700	1,375.00	22,962,500
北越工業	17,200	842.00	14,482,400
ダイキン工業	224,800	21,565.00	4,847,812,000
オルガノ	5,600	10,050.00	56,280,000
トーヨーカネツ	7,100	2,754.00	19,553,400
栗田工業	100,900	5,390.00	543,851,000
椿本チエイン	25,600	3,335.00	85,376,000
大同工業	8,500	859.00	7,301,500
木村化工機	15,900	699.00	11,114,100
アネスト岩田	30,500	883.00	26,931,500
ダイフク	97,100	8,280.00	803,988,000
サムコ	5,200	2,778.00	14,445,600
加藤製作所	9,600	842.00	8,083,200
油研工業	3,300	1,770.00	5,841,000
タダノ	97,000	967.00	93,799,000
フジテック	63,200	2,685.00	169,692,000
C K D	52,100	1,901.00	99,042,100
キトー	15,800	2,642.00	41,743,600

平和	54,400	1,945.00	105,808,000
理想科学工業	15,800	2,236.00	35,328,800
SANKYO	42,200	4,260.00	179,772,000
日本金銭機械	19,900	677.00	13,472,300
マースグループホールディングス	12,400	1,716.00	21,278,400
フクシマガリレイ	12,500	3,390.00	42,375,000
オーイズミ	7,100	424.00	3,010,400
ダイコク電機	9,000	1,218.00	10,962,000
竹内製作所	29,700	2,488.00	73,893,600
アマノ	51,100	2,485.00	126,983,500
JUKI	27,100	738.00	19,999,800
ジャノメ	16,700	703.00	11,740,100
マックス	24,100	1,609.00	38,776,900
グローリー	47,600	2,054.00	97,770,400
新晃工業	18,200	1,643.00	29,902,600
大和冷機工業	28,300	1,060.00	29,998,000
セガサミーホールディングス	193,500	2,379.00	460,336,500
日本ピストンリング	7,200	1,331.00	9,583,200
リケン	7,600	2,427.00	18,445,200
TPR	23,400	1,272.00	29,764,800
ツバキ・ナカシマ	42,900	1,007.00	43,200,300
ホシザキ	57,000	7,710.00	439,470,000
大豊工業	16,100	726.00	11,688,600
日本精工	345,000	780.00	269,100,000
NTN	376,100	296.00	111,325,600
ジェイテクト	173,300	1,101.00	190,803,300
不二越	14,600	3,785.00	55,261,000
日本トムソン	47,700	546.00	26,044,200
THK	110,100	2,871.00	316,097,100
ユーシン精機	15,300	705.00	10,786,500
前澤給装工業	13,400	860.00	11,524,000
イーグル工業	22,200	1,005.00	22,311,000
前澤工業	12,300	618.00	7,601,400
日本ピラー工業	17,700	2,918.00	51,648,600
キッツ	58,500	699.00	40,891,500
マキタ	226,100	3,613.00	816,899,300
三井E&Sホールディングス	70,700	390.00	27,573,000
日立造船	158,400	918.00	145,411,200
三菱重工業	292,800	5,483.00	1,605,422,400
IHI	121,800	4,150.00	505,470,000
スター精密	27,300	1,770.00	48,321,000
日清紡ホールディングス	112,600	1,108.00	124,760,800

イビデン	97,000	4,435.00	430,195,000
コニカミノルタ	409,000	460.00	188,140,000
ブラザー工業	228,200	2,424.00	553,156,800
ミネベアミツミ	319,500	2,528.00	807,696,000
日立製作所	937,900	6,945.00	6,513,715,500
東芝	340,800	5,669.00	1,931,995,200
三菱電機	1,863,300	1,476.00	2,750,230,800
富士電機	111,500	6,160.00	686,840,000
東洋電機製造	6,700	919.00	6,157,300
安川電機	199,100	4,645.00	924,819,500
シンフォニアテクノロジー	21,000	1,420.00	29,820,000
明電舎	29,400	2,068.00	60,799,200
オリジン	4,600	1,256.00	5,777,600
山洋電気	7,900	5,530.00	43,687,000
デンヨー	14,800	1,593.00	23,576,400
PHCホールディングス	31,200	1,345.00	41,964,000
東芝テック	20,900	4,160.00	86,944,000
芝浦メカトロニクス	3,600	11,280.00	40,608,000
マブチモーター	45,100	3,730.00	168,223,000
日本電産	457,500	8,866.00	4,056,195,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	10,600	468.00	4,960,800
トレックス・セミコンダクター	9,400	2,907.00	27,325,800
東光高岳	11,700	1,795.00	21,001,500
ダイヘン	19,100	4,335.00	82,798,500
ヤーマン	33,000	1,276.00	42,108,000
JVCケンウッド	166,900	191.00	31,877,900
ミマキエンジニアリング	20,100	569.00	11,436,900
I - P E X	10,100	1,404.00	14,180,400
日新電機	45,700	1,571.00	71,794,700
大崎電気工業	33,800	500.00	16,900,000
オムロン	162,300	7,441.00	1,207,674,300
日東工業	24,500	2,333.00	57,158,500
I D E C	24,100	2,733.00	65,865,300
正興電機製作所	6,900	1,156.00	7,976,400
不二電機工業	5,000	1,141.00	5,705,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	60,900	2,193.00	133,553,700
サクサホールディングス	4,500	1,468.00	6,606,000
メルコホールディングス	5,500	3,495.00	19,222,500
テクノメディカ	5,300	1,580.00	8,374,000
日本電気	236,800	5,260.00	1,245,568,000
富士通	175,400	18,435.00	3,233,499,000
沖電気工業	75,700	801.00	60,635,700

岩崎通信機	7,900	831.00	6,564,900
電気興業	9,700	2,594.00	25,161,800
サンケン電気	17,200	5,370.00	92,364,000
ナカヨ	3,300	1,113.00	3,672,900
アイホン	9,600	1,723.00	16,540,800
ルネサスエレクトロニクス	1,060,800	1,439.00	1,526,491,200
セイコーエプソン	225,800	2,231.00	503,759,800
ワコム	152,900	927.00	141,738,300
アルバック	38,800	5,290.00	205,252,000
アクセル	9,500	848.00	8,056,000
E I Z O	14,200	3,815.00	54,173,000
日本信号	44,100	927.00	40,880,700
京三製作所	39,300	435.00	17,095,500
能美防災	24,200	1,763.00	42,664,600
ホーチキ	14,000	1,269.00	17,766,000
星和電機	11,400	492.00	5,608,800
エレコム	45,600	1,512.00	68,947,200
パナソニック ホールディングス	2,079,800	1,144.00	2,379,291,200
シャープ	197,600	1,026.00	202,737,600
アンリツ	125,600	1,507.00	189,279,200
富士通ゼネラル	52,900	2,474.00	130,874,600
ソニーグループ	1,221,500	12,130.00	14,816,795,000
T D K	282,800	4,690.00	1,326,332,000
帝国通信工業	9,700	1,378.00	13,366,600
タムラ製作所	71,800	583.00	41,859,400
アルプスアルパイン	164,700	1,502.00	247,379,400
池上通信機	5,700	614.00	3,499,800
日本電波工業	20,800	1,178.00	24,502,400
鈴木	11,400	839.00	9,564,600
メイコー	21,500	4,050.00	87,075,000
日本トリム	4,300	2,490.00	10,707,000
ローランド ディー・ジー	12,000	3,350.00	40,200,000
フォスター電機	18,700	750.00	14,025,000
S M K	4,500	2,164.00	9,738,000
ヨコオ	14,100	2,303.00	32,472,300
ホシデン	45,600	1,227.00	55,951,200
ヒロセ電機	28,500	17,720.00	505,020,000
日本航空電子工業	41,000	2,140.00	87,740,000
T O A	20,900	781.00	16,322,900
マクセル	37,700	1,323.00	49,877,100
古野電気	24,600	1,070.00	26,322,000
ユニデンホールディングス	4,300	3,535.00	15,200,500

スミダコーポレーション	20,100	829.00	16,662,900
アイコム	6,600	2,430.00	16,038,000
リオン	7,500	2,602.00	19,515,000
本多通信工業	17,900	548.00	9,809,200
横河電機	184,300	2,379.00	438,449,700
新電元工業	7,100	3,340.00	23,714,000
アズビル	114,300	3,600.00	411,480,000
東亜ディーケーケー	11,300	905.00	10,226,500
日本光電工業	77,500	3,035.00	235,212,500
チノー	6,200	1,642.00	10,180,400
共和電業	18,700	335.00	6,264,500
日本電子材料	9,400	1,910.00	17,954,000
堀場製作所	34,300	6,740.00	231,182,000
アドバンテスト	145,000	8,210.00	1,190,450,000
小野測器	11,100	446.00	4,950,600
エスベック	15,700	1,895.00	29,751,500
キーエンス	176,700	50,390.00	8,903,913,000
日置電機	9,500	7,150.00	67,925,000
シスメックス	148,300	8,458.00	1,254,321,400
日本マイクロニクス	31,700	1,422.00	45,077,400
メガチップス	17,700	3,310.00	58,587,000
O B A R A G R O U P	8,500	2,943.00	25,015,500
澤藤電機	3,300	1,521.00	5,019,300
原田工業	10,800	941.00	10,162,800
コーセル	23,500	800.00	18,800,000
イリソ電子工業	16,800	3,355.00	56,364,000
オブテックスグループ	32,700	2,068.00	67,623,600
千代田インテグレ	8,400	2,029.00	17,043,600
レーザーテック	81,900	17,370.00	1,422,603,000
スタンレー電気	129,800	2,344.00	304,251,200
岩崎電気	7,100	2,550.00	18,105,000
ウシオ電機	95,700	1,732.00	165,752,400
岡谷電機産業	19,300	274.00	5,288,200
ヘリオス テクノ ホールディング	21,700	292.00	6,336,400
エノモト	6,300	1,630.00	10,269,000
日本セラミック	18,900	2,093.00	39,557,700
遠藤照明	10,900	772.00	8,414,800
古河電池	15,100	1,231.00	18,588,100
双信電機	11,900	577.00	6,866,300
山一電機	14,000	1,917.00	26,838,000
図研	13,200	2,991.00	39,481,200
日本電子	38,700	5,910.00	228,717,000



カシオ計算機	125,600	1,285.00	161,396,000
ファナック	171,100	21,320.00	3,647,852,000
日本シイエムケイ	38,900	469.00	18,244,100
エンプラス	5,200	3,480.00	18,096,000
大真空	26,300	995.00	26,168,500
ローム	83,300	10,470.00	872,151,000
浜松ホトニクス	133,500	6,060.00	809,010,000
三井ハイテック	17,700	11,560.00	204,612,000
新光電気工業	57,600	4,455.00	256,608,000
京セラ	274,500	7,487.00	2,055,181,500
太陽誘電	89,600	5,480.00	491,008,000
村田製作所	545,700	8,411.00	4,589,882,700
双葉電子工業	35,600	682.00	24,279,200
北陸電気工業	8,500	1,169.00	9,936,500
ニチコン	56,200	1,389.00	78,061,800
日本ケミコン	19,200	1,933.00	37,113,600
K O A	28,600	1,736.00	49,649,600
市光工業	27,200	391.00	10,635,200
小糸製作所	100,900	4,875.00	491,887,500
ミツバ	32,200	413.00	13,298,600
S C R E E Nホールディングス	31,800	11,200.00	356,160,000
キャノン電子	18,900	1,549.00	29,276,100
キャノン	968,900	3,328.00	3,224,499,200
リコー	489,700	1,159.00	567,562,300
象印マホービン	50,900	1,431.00	72,837,900
M U T O Hホールディングス	3,200	2,083.00	6,665,600
東京エレクトロン	123,700	55,660.00	6,885,142,000
トヨタ紡織	72,000	2,184.00	157,248,000
芦森工業	3,700	1,024.00	3,788,800
ユニプレス	31,000	948.00	29,388,000
豊田自動織機	144,700	8,440.00	1,221,268,000
モリタホールディングス	31,200	1,309.00	40,840,800
三櫻工業	27,000	682.00	18,414,000
デンソー	397,500	8,131.00	3,232,072,500
東海理化電機製作所	51,300	1,495.00	76,693,500
川崎重工業	135,600	2,943.00	399,070,800
名村造船所	53,000	429.00	22,737,000
日本車輛製造	6,500	2,082.00	13,533,000
三菱ロジスネクスト	25,800	834.00	21,517,200
近畿車輛	2,900	1,166.00	3,381,400
日産自動車	2,299,700	564.00	1,297,030,800
いすゞ自動車	580,500	1,645.00	954,922,500

トヨタ自動車	9,219,200	2,203.50	20,314,507,200
日野自動車	243,500	715.00	174,102,500
三菱自動車工業	721,800	453.00	326,975,400
エフテック	12,800	580.00	7,424,000
レシップホールディングス	7,700	560.00	4,312,000
G M B	3,500	721.00	2,523,500
ファルテック	3,400	611.00	2,077,400
武蔵精密工業	43,500	1,425.00	61,987,500
日産車体	28,600	604.00	17,274,400
新明和工業	52,300	1,162.00	60,772,600
極東開発工業	32,800	1,460.00	47,888,000
トピー工業	15,100	1,365.00	20,611,500
ティラド	5,000	2,829.00	14,145,000
曙ブレーキ工業	107,000	171.00	18,297,000
タチエス	32,700	1,180.00	38,586,000
N O K	80,400	1,227.00	98,650,800
フタバ産業	45,200	400.00	18,080,000
K Y B	18,200	3,085.00	56,147,000
大同メタル工業	37,400	534.00	19,971,600
プレス工業	89,600	443.00	39,692,800
ミクニ	23,400	368.00	8,611,200
太平洋工業	38,400	1,083.00	41,587,200
河西工業	23,900	284.00	6,787,600
アイシン	142,700	4,415.00	630,020,500
マツダ	586,500	1,174.00	688,551,000
今仙電機製作所	12,800	615.00	7,872,000
本田技研工業	1,462,200	3,398.00	4,968,555,600
スズキ	406,400	4,058.00	1,649,171,200
S U B A R U	527,800	2,544.50	1,342,987,100
安永	8,400	756.00	6,350,400
ヤマハ発動機	254,400	2,742.00	697,564,800
T B K	20,200	346.00	6,989,200
エクセディ	29,400	1,795.00	52,773,000
豊田合成	57,700	2,186.00	126,132,200
愛三工業	30,500	757.00	23,088,500
盟和産業	2,800	1,018.00	2,850,400
日本プラスト	14,500	470.00	6,815,000
ヨロズ	16,200	918.00	14,871,600
エフ・シー・シー	31,900	1,393.00	44,436,700
シマノ	74,300	22,150.00	1,645,745,000
テイ・エス テック	82,300	1,431.00	117,771,300
ジャムコ	11,400	1,215.00	13,851,000

テルモ	551,800	4,110.00	2,267,898,000
クリエートメディック	5,900	991.00	5,846,900
日機装	52,500	874.00	45,885,000
日本エム・ディ・エム	11,200	1,588.00	17,785,600
島津製作所	239,000	4,715.00	1,126,885,000
JMS	15,500	585.00	9,067,500
長野計器	13,400	1,172.00	15,704,800
ブイ・テクノロジー	8,500	2,945.00	25,032,500
東京計器	12,400	1,495.00	18,538,000
愛知時計電機	7,500	1,471.00	11,032,500
インターアクション	9,800	2,040.00	19,992,000
オーバル	17,500	312.00	5,460,000
東京精密	31,300	4,730.00	148,049,000
マニー	73,400	1,436.00	105,402,400
ニコン	282,500	1,735.00	490,137,500
トプコン	91,700	1,935.00	177,439,500
オリンパス	970,200	2,800.00	2,716,560,000
理研計器	13,900	3,965.00	55,113,500
タムロン	14,100	2,449.00	34,530,900
HOYA	376,500	13,285.00	5,001,802,500
シード	9,200	517.00	4,756,400
ノーリツ鋼機	17,500	2,459.00	43,032,500
A & Dホロンホールディングス	21,900	1,004.00	21,987,600
朝日インテック	213,800	1,926.00	411,778,800
シチズン時計	203,100	583.00	118,407,300
リズム	6,100	1,891.00	11,535,100
大研医器	15,500	499.00	7,734,500
メニコン	61,700	2,841.00	175,289,700
シンシア	2,200	432.00	950,400
松風	7,100	1,685.00	11,963,500
セイコーホールディングス	27,600	2,845.00	78,522,000
ニプロ	138,400	1,035.00	143,244,000
中本パックス	5,400	1,616.00	8,726,400
スノーピーク	25,400	2,784.00	70,713,600
パラマウントベッドホールディングス	37,400	2,019.00	75,510,600
トランザクション	11,900	1,101.00	13,101,900
粧美堂	5,100	411.00	2,096,100
ニホンフラッシュ	15,700	981.00	15,401,700
前田工織	18,900	2,646.00	50,009,400
永大産業	22,700	273.00	6,197,100
アートネイチャー	16,700	730.00	12,191,000
バンダイナムコホールディングス	165,800	9,809.00	1,626,332,200

アイフィスジャパン	5,000	663.00	3,315,000	
共立印刷	28,700	153.00	4,391,100	
S H O E I	17,500	5,150.00	90,125,000	
フランスベッドホールディングス	25,100	890.00	22,339,000	
パイロットコーポレーション	29,500	5,120.00	151,040,000	
萩原工業	12,000	1,152.00	13,824,000	
フジシールインターナショナル	42,500	1,526.00	64,855,000	
タカラトミー	80,500	1,289.00	103,764,500	
広済堂ホールディングス	12,100	1,152.00	13,939,200	
エステールホールディングス	4,300	638.00	2,743,400	
タカノ	6,700	821.00	5,500,700	
プロネクサス	15,100	1,084.00	16,368,400	
ホクシン	13,700	148.00	2,027,600	
ウッドワン	6,000	1,203.00	7,218,000	
大建工業	10,400	1,814.00	18,865,600	
凸版印刷	268,200	2,374.00	636,706,800	
大日本印刷	217,700	2,844.00	619,138,800	
共同印刷	5,200	2,645.00	13,754,000	
N I S S H A	35,900	1,551.00	55,680,900	
光村印刷	1,600	1,269.00	2,030,400	
T A K A R A & C O M P A N Y	11,400	1,838.00	20,953,200	
アシックス	157,100	2,591.00	407,046,100	
ツツミ	4,900	1,961.00	9,608,900	
ローランド	13,600	4,515.00	61,404,000	
小松ウオール工業	5,900	1,894.00	11,174,600	
ヤマハ	113,400	5,750.00	652,050,000	
河合楽器製作所	5,100	2,805.00	14,305,500	
クリナップ	18,100	571.00	10,335,100	
ビジョン	117,800	1,854.00	218,401,200	
兼松サステック	1,300	1,635.00	2,125,500	
キングジム	15,200	913.00	13,877,600	
リンテック	38,700	2,430.00	94,041,000	
イトーキ	35,900	386.00	13,857,400	
任天堂	110,100	58,940.00	6,489,294,000	
三菱鉛筆	28,200	1,379.00	38,887,800	
タカラスタANDARD	34,300	1,260.00	43,218,000	
コクヨ	88,300	1,631.00	144,017,300	
ナカバヤシ	16,300	496.00	8,084,800	
グローブライド	15,500	2,249.00	34,859,500	
オカムラ	58,900	1,089.00	64,142,100	
美津濃	17,200	2,260.00	38,872,000	
東京電力ホールディングス	1,459,300	508.00	741,324,400	

中部電力	566,000	1,266.00	716,556,000
関西電力	700,900	1,227.00	860,004,300
中国電力	289,100	836.00	241,687,600
北陸電力	169,800	518.00	87,956,400
東北電力	436,400	709.00	309,407,600
四国電力	166,600	747.00	124,450,200
九州電力	382,800	831.00	318,106,800
北海道電力	169,400	476.00	80,634,400
沖縄電力	41,400	1,212.00	50,176,800
電源開発	151,500	2,168.00	328,452,000
エフオン	11,800	566.00	6,678,800
イーレックス	26,300	2,194.00	57,702,200
レノバ	38,200	2,078.00	79,379,600
東京瓦斯	356,000	2,714.00	966,184,000
大阪瓦斯	336,400	2,583.00	868,921,200
東邦瓦斯	80,700	3,235.00	261,064,500
北海道瓦斯	9,700	1,624.00	15,752,800
広島ガス	35,100	322.00	11,302,200
西部ガスホールディングス	19,700	1,900.00	37,430,000
静岡ガス	47,700	867.00	41,355,900
メタウォーター	20,200	2,061.00	41,632,200
SBSホールディングス	14,400	2,912.00	41,932,800
東武鉄道	182,100	3,055.00	556,315,500
相鉄ホールディングス	59,400	2,302.00	136,738,800
東急	466,600	1,534.00	715,764,400
京浜急行電鉄	228,200	1,435.00	327,467,000
小田急電鉄	260,300	1,771.00	460,991,300
京王電鉄	90,800	4,625.00	419,950,000
京成電鉄	121,800	3,640.00	443,352,000
富士急行	21,000	4,140.00	86,940,000
新京成電鉄	4,500	2,932.00	13,194,000
東日本旅客鉄道	312,700	7,043.00	2,202,346,100
西日本旅客鉄道	216,700	5,033.00	1,090,651,100
東海旅客鉄道	145,500	16,250.00	2,364,375,000
西武ホールディングス	241,500	1,405.00	339,307,500
鴻池運輸	28,700	1,193.00	34,239,100
西日本鉄道	49,200	2,848.00	140,121,600
ハマキョウレックス	13,000	2,963.00	38,519,000
サカイ引越センター	9,000	4,445.00	40,005,000
近鉄グループホールディングス	177,000	4,005.00	708,885,000
阪急阪神ホールディングス	220,700	3,615.00	797,830,500
南海電気鉄道	79,000	2,604.00	205,716,000

京阪ホールディングス	75,400	3,340.00	251,836,000
神戸電鉄	4,400	3,280.00	14,432,000
名古屋鉄道	186,600	2,210.00	412,386,000
山陽電気鉄道	13,500	2,104.00	28,404,000
アルプス物流	12,900	1,124.00	14,499,600
ヤマトホールディングス	258,800	2,142.00	554,349,600
山九	46,100	3,910.00	180,251,000
丸運	9,400	241.00	2,265,400
丸全昭和運輸	13,300	3,045.00	40,498,500
センコーグループホールディングス	88,800	859.00	76,279,200
トナミホールディングス	3,800	3,500.00	13,300,000
ニッコンホールディングス	59,200	2,098.00	124,201,600
日本石油輸送	2,000	2,551.00	5,102,000
福山通運	25,900	3,225.00	83,527,500
セイノーホールディングス	109,000	1,040.00	113,360,000
エスライン	5,200	857.00	4,456,400
神奈川中央交通	4,600	3,425.00	15,755,000
日立物流	35,600	8,570.00	305,092,000
丸和運輸機関	33,800	1,513.00	51,139,400
C & F ロジホールディングス	16,600	1,036.00	17,197,600
九州旅客鉄道	130,200	2,679.00	348,805,800
S Gホールディングス	323,100	2,275.00	735,052,500
NIPPON EXPRESSホールディングス	57,900	7,770.00	449,883,000
日本郵船	155,000	9,810.00	1,520,550,000
商船三井	293,900	3,230.00	949,297,000
川崎汽船	56,900	9,190.00	522,911,000
NSユナイテッド海運	10,600	3,950.00	41,870,000
飯野海運	84,500	748.00	63,206,000
共栄タンカー	8,400	1,035.00	8,694,000
乾汽船	11,600	1,790.00	20,764,000
日本航空	405,800	2,357.00	956,470,600
ANAホールディングス	449,600	2,538.50	1,141,309,600
パスコ	3,500	1,314.00	4,599,000
ランコム	5,200	6,450.00	33,540,000
日新	13,900	1,612.00	22,406,800
三菱倉庫	51,500	3,185.00	164,027,500
三井倉庫ホールディングス	18,600	2,996.00	55,725,600
住友倉庫	57,500	2,104.00	120,980,000
澁澤倉庫	9,800	2,272.00	22,265,600
東陽倉庫	27,800	305.00	8,479,000
日本トランスシティ	35,200	518.00	18,233,600
ケイヒン	3,200	1,350.00	4,320,000

中央倉庫	10,100	983.00	9,928,300
川西倉庫	3,400	1,109.00	3,770,600
安田倉庫	13,300	956.00	12,714,800
ファイブホールディングス	3,900	797.00	3,108,300
東洋埠頭	5,300	1,330.00	7,049,000
上組	95,200	2,560.00	243,712,000
サンリツ	4,800	763.00	3,662,400
キムラユニティー	4,800	1,501.00	7,204,800
キューソー流通システム	9,200	1,097.00	10,092,400
近鉄エクスプレス	34,900	4,175.00	145,707,500
東海運	10,500	295.00	3,097,500
エーアイティー	11,600	1,492.00	17,307,200
内外トランスライン	7,100	1,937.00	13,752,700
日本コンセプト	5,900	1,575.00	9,292,500
NEC ネットズエスアイ	63,400	1,863.00	118,114,200
クロスキャット	10,200	1,034.00	10,546,800
システナ	273,400	443.00	121,116,200
デジタルアーツ	10,300	6,340.00	65,302,000
日鉄ソリューションズ	31,400	3,695.00	116,023,000
キューブシステム	9,900	925.00	9,157,500
WOW WORLD	2,800	1,112.00	3,113,600
コア	8,200	1,449.00	11,881,800
手間いらず	2,800	5,370.00	15,036,000
ラクーンホールディングス	16,400	1,375.00	22,550,000
ソリトンシステムズ	9,700	1,276.00	12,377,200
ソフトクリエイトホールディングス	8,400	4,035.00	33,894,000
T I S	172,400	3,405.00	587,022,000
J N Sホールディングス	8,800	462.00	4,065,600
グリー	87,300	898.00	78,395,400
G M Oペパボ	2,100	2,097.00	4,403,700
コーエーテクモホールディングス	61,100	4,565.00	278,921,500
三菱総合研究所	9,000	4,200.00	37,800,000
電算	2,200	2,268.00	4,989,600
A G S	8,600	753.00	6,475,800
ファインデックス	16,400	634.00	10,397,600
ブレインパッド	16,400	1,187.00	19,466,800
K L a b	33,500	505.00	16,917,500
ポルトゥウィンホールディングス	27,900	1,080.00	30,132,000
ネクソン	434,800	3,260.00	1,417,448,000
アイスタイル	50,300	245.00	12,323,500
エムアップホールディングス	22,300	1,250.00	27,875,000
エイチーム	12,700	720.00	9,144,000

エニグモ	21,000	549.00	11,529,000
テクノスジャパン	15,200	504.00	7,660,800
コロプラ	63,300	639.00	40,448,700
ブロードリーフ	95,300	425.00	40,502,500
クロス・マーケティンググループ	7,500	864.00	6,480,000
デジタルハーツホールディングス	8,800	1,723.00	15,162,400
システム情報	14,500	1,019.00	14,775,500
メディアドゥ	6,800	1,878.00	12,770,400
じげん	54,700	355.00	19,418,500
ブイキューブ	19,700	1,042.00	20,527,400
エンカレッジ・テクノロジー	4,600	525.00	2,415,000
サイバーリンクス	6,600	1,121.00	7,398,600
フィックスターズ	19,200	950.00	18,240,000
CARTA HOLDINGS	7,900	1,923.00	15,191,700
オブティム	13,600	852.00	11,587,200
セレス	7,300	1,384.00	10,103,200
SHIFT	11,100	19,260.00	213,786,000
ティーガイア	17,100	1,623.00	27,753,300
セック	2,900	2,520.00	7,308,000
テクマトリックス	32,500	1,698.00	55,185,000
プロシップ	6,500	1,454.00	9,451,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	49,800	2,464.00	122,707,200
GMOペイメントゲートウェイ	37,100	10,320.00	382,872,000
ザッパラス	7,400	407.00	3,011,800
システムリサーチ	5,700	2,025.00	11,542,500
インターネットイニシアティブ	51,000	4,710.00	240,210,000
さくらインターネット	20,900	572.00	11,954,800
ヴィンクス	5,600	1,105.00	6,188,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,300	5,950.00	25,585,000
SRAホールディングス	9,300	2,865.00	26,644,500
システムインテグレータ	6,500	499.00	3,243,500
朝日ネット	17,800	602.00	10,715,600
eBASE	23,200	552.00	12,806,400
アバント	20,700	1,354.00	28,027,800
アドソル日進	7,000	1,549.00	10,843,000
ODKソリューションズ	4,300	570.00	2,451,000
フリービット	10,100	922.00	9,312,200
コムチュア	21,500	2,787.00	59,920,500
サイバーコム	3,100	1,151.00	3,568,100
アステリア	13,900	1,101.00	15,303,900
アイル	9,700	1,549.00	15,025,300
マークラインズ	9,700	2,257.00	21,892,900



メディカル・データ・ビジョン	24,400	1,019.00	24,863,600
g u m i	26,900	571.00	15,359,900
ショーケース	4,600	461.00	2,120,600
モバイルファクトリー	4,500	1,161.00	5,224,500
テラスカイ	7,100	1,474.00	10,465,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,600	1,430.00	12,298,000
P C Iホールディングス	8,100	1,025.00	8,302,500
パイプドHD	3,600	2,810.00	10,116,000
アイビーシー	3,300	492.00	1,623,600
ネオジャパン	5,600	1,250.00	7,000,000
P R T I M E S	4,200	2,092.00	8,786,400
ラクス	87,900	1,582.00	139,057,800
ランドコンピュータ	4,600	907.00	4,172,200
ダブルスタンダード	5,900	1,944.00	11,469,600
オープンドア	11,500	1,939.00	22,298,500
マイネット	6,800	525.00	3,570,000
アカツキ	8,600	2,916.00	25,077,600
ベネフィットジャパン	1,500	1,985.00	2,977,500
U b i c o mホールディングス	5,100	2,525.00	12,877,500
カナミックネットワーク	22,700	525.00	11,917,500
ノムラシステムコーポレーション	10,700	228.00	2,439,600
チェンジ	38,400	1,906.00	73,190,400
シンクロ・フード	10,400	350.00	3,640,000
オークネット	10,300	1,862.00	19,178,600
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	694.00	2,706,600
セグエグループ	5,300	560.00	2,968,000
エイトレッド	2,800	2,058.00	5,762,400
マクロミル	38,600	976.00	37,673,600
ビーグリー	4,700	1,411.00	6,631,700
オロ	6,000	1,797.00	10,782,000
ユーザーローカル	5,900	1,674.00	9,876,600
テモナ	4,200	385.00	1,617,000
ニーズウェル	5,400	678.00	3,661,200
マネーフォワード	39,000	3,420.00	133,380,000
サインポスト	6,200	883.00	5,474,600
電算システムホールディングス	7,900	2,416.00	19,086,400
ソルクシーズ	16,800	381.00	6,400,800
フェイス	5,300	666.00	3,529,800
プロトコーポレーション	20,500	989.00	20,274,500
ハイマックス	5,200	1,286.00	6,687,200
野村総合研究所	345,100	3,680.00	1,269,968,000
サイバネットシステム	13,900	766.00	10,647,400

C Eホールディングス	10,000	441.00	4,410,000
日本システム技術	3,600	2,586.00	9,309,600
インテージホールディングス	22,200	1,462.00	32,456,400
東邦システムサイエンス	5,300	940.00	4,982,000
ソースネクスト	83,300	272.00	22,657,600
インフォコム	21,000	2,181.00	45,801,000
シンプレクス・ホールディングス	30,400	1,910.00	58,064,000
HEROZ	5,700	974.00	5,551,800
ラクスル	22,300	2,225.00	49,617,500
I P S	5,300	2,416.00	12,804,800
F I G	21,400	313.00	6,698,200
システムサポート	7,100	1,180.00	8,378,000
イーソル	12,000	591.00	7,092,000
アルテリア・ネットワークス	20,400	1,264.00	25,785,600
東海ソフト	3,200	997.00	3,190,400
ウイングアーク1 s t	14,700	1,455.00	21,388,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,500	1,583.00	7,123,500
サーバーワークス	3,400	2,168.00	7,371,200
東名	1,700	1,196.00	2,033,200
ヴィッツ	1,900	1,186.00	2,253,400
トピラシステムズ	4,100	782.00	3,206,200
S a n s a n	63,200	1,012.00	63,958,400
L i n k - U	3,700	674.00	2,493,800
ギフトィ	16,500	1,230.00	20,295,000
ベース	3,300	5,830.00	19,239,000
J M D C	24,000	5,160.00	123,840,000
フォーカスシステムズ	12,400	912.00	11,308,800
クレスコ	14,000	2,032.00	28,448,000
フジ・メディア・ホールディングス	175,100	1,168.00	204,516,800
オービック	60,300	19,210.00	1,158,363,000
ジャストシステム	27,300	4,075.00	111,247,500
T D C ソフト	15,900	1,031.00	16,392,900
Zホールディングス	2,759,700	431.00	1,189,430,700
トレンドマイクロ	96,600	7,200.00	695,520,000
I Dホールディングス	12,300	854.00	10,504,200
日本オラクル	31,100	7,610.00	236,671,000
アルファシステムズ	5,200	4,195.00	21,814,000
フューチャー	40,500	1,620.00	65,610,000
C A C H o l d i n g s	10,500	1,446.00	15,183,000
S Bテクノロジー	8,400	2,325.00	19,530,000
トーセ	5,100	771.00	3,932,100
オービックビジネスコンサルタント	18,300	4,490.00	82,167,000

伊藤忠テクノソリューションズ	87,200	3,230.00	281,656,000
アイティフォー	23,400	792.00	18,532,800
東計電算	2,300	5,940.00	13,662,000
エクスネット	3,200	1,010.00	3,232,000
大塚商会	103,600	3,995.00	413,882,000
サイボウズ	25,700	1,036.00	26,625,200
電通国際情報サービス	25,000	3,975.00	99,375,000
A C C E S S	21,900	704.00	15,417,600
デジタルガレージ	31,700	4,030.00	127,751,000
E Mシステムズ	31,800	963.00	30,623,400
ウェザーニューズ	6,000	6,430.00	38,580,000
C I J	15,100	797.00	12,034,700
ビジネスエンジニアリング	4,500	2,115.00	9,517,500
日本エンタープライズ	20,700	162.00	3,353,400
WOWOW	8,400	1,507.00	12,658,800
スカラ	16,300	773.00	12,599,900
インテリジェント ウェイブ	9,900	712.00	7,048,800
I M A G I C A G R O U P	14,700	779.00	11,451,300
ネットワンシステムズ	70,600	2,873.00	202,833,800
システムソフト	53,300	109.00	5,809,700
アルゴグラフィックス	15,000	3,085.00	46,275,000
マーベラス	30,400	698.00	21,219,200
エイベックス	33,200	1,310.00	43,492,000
B I P R O G Y	59,800	2,954.00	176,649,200
兼松エレクトロニクス	10,500	3,985.00	41,842,500
都築電気	9,100	1,334.00	12,139,400
T B S ホールディングス	100,500	1,788.00	179,694,000
日本テレビホールディングス	159,900	1,304.00	208,509,600
朝日放送グループホールディングス	16,800	666.00	11,188,800
テレビ朝日ホールディングス	46,100	1,540.00	70,994,000
スカパーJ S A Tホールディングス	162,500	502.00	81,575,000
テレビ東京ホールディングス	12,400	2,008.00	24,899,200
日本BS放送	6,700	1,058.00	7,088,600
ビジョン	31,600	1,414.00	44,682,400
スマートバリュー	4,800	513.00	2,462,400
U S E N - N E X T H O L D I N G S	15,900	2,028.00	32,245,200
ワイヤレスゲート	8,500	319.00	2,711,500
コネクシオ	13,700	1,305.00	17,878,500
クロップス	3,700	1,047.00	3,873,900
日本電信電話	2,097,000	3,941.00	8,264,277,000
K D D I	1,395,000	4,488.00	6,260,760,000
ソフトバンク	2,898,200	1,470.00	4,260,354,000

光通信	22,100	13,970.00	308,737,000
エムティーアイ	16,500	457.00	7,540,500
GMOインターネット	67,100	2,550.00	171,105,000
ファイバーゲート	8,900	986.00	8,775,400
アйдママーケティングコミュニケーション	4,800	323.00	1,550,400
KADOKAWA	103,600	2,821.00	292,255,600
学研ホールディングス	27,300	881.00	24,051,300
ゼンリン	31,400	920.00	28,888,000
昭文社ホールディングス	8,200	392.00	3,214,400
インプレスホールディングス	15,800	220.00	3,476,000
アイネット	9,300	1,231.00	11,448,300
松竹	11,500	13,300.00	152,950,000
東宝	112,900	5,150.00	581,435,000
東映	5,700	18,120.00	103,284,000
エヌ・ティ・ティ・データ	509,500	1,949.00	993,015,500
ピー・シー・エー	11,400	1,186.00	13,520,400
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,475.00	8,997,500
DTS	35,700	3,110.00	111,027,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	89,000	6,200.00	551,800,000
シーイーシー	20,700	1,241.00	25,688,700
カブコン	180,500	3,500.00	631,750,000
アイ・エス・ビー	9,100	1,052.00	9,573,200
ジャステック	11,200	1,191.00	13,339,200
SCSK	132,500	2,245.00	297,462,500
日本システムウエア	7,300	2,487.00	18,155,100
アイネス	16,200	1,549.00	25,093,800
TKC	30,300	3,320.00	100,596,000
富士ソフト	19,100	7,400.00	141,340,000
NSD	60,000	2,391.00	143,460,000
コナミホールディングス	69,500	8,590.00	597,005,000
福井コンピュータホールディングス	8,800	3,280.00	28,864,000
JBCホールディングス	13,000	1,628.00	21,164,000
ミロク情報サービス	17,000	1,170.00	19,890,000
ソフトバンクグループ	1,147,400	5,545.00	6,362,333,000
高千穂交易	7,000	1,870.00	13,090,000
オルバヘルスケアホールディングス	3,100	1,795.00	5,564,500
伊藤忠食品	4,100	4,730.00	19,393,000
エレマテック	15,400	1,330.00	20,482,000
あらた	14,600	3,960.00	57,816,000
トーメンデバイス	2,900	5,990.00	17,371,000
東京エレクトロン デバイス	5,700	5,710.00	32,547,000
フィールズ	16,800	1,045.00	17,556,000

双日	202,000	2,146.00	433,492,000
アルフレッサ ホールディングス	204,000	1,666.00	339,864,000
横浜冷凍	49,100	845.00	41,489,500
ラサ商事	9,000	972.00	8,748,000
アルコニックス	24,200	1,340.00	32,428,000
神戸物産	138,100	3,180.00	439,158,000
ハイパー	4,900	470.00	2,303,000
あい ホールディングス	27,400	1,634.00	44,771,600
ディーブイエックス	6,600	1,076.00	7,101,600
ダイワボウホールディングス	85,600	1,750.00	149,800,000
マクニカ・富士エレホールディングス	45,800	2,953.00	135,247,400
ラクト・ジャパン	6,600	2,055.00	13,563,000
グリムス	8,600	1,504.00	12,934,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,600	692.00	21,867,200
八洲電機	13,900	975.00	13,552,500
メディアスホールディングス	11,000	1,010.00	11,110,000
レスターホールディングス	18,200	2,014.00	36,654,800
ジューテックホールディングス	4,000	1,009.00	4,036,000
大光	8,200	718.00	5,887,600
OCHIホールディングス	4,800	1,251.00	6,004,800
TOKAIホールディングス	93,100	865.00	80,531,500
黒谷	5,300	601.00	3,185,300
Cominix	3,400	724.00	2,461,600
三洋貿易	18,200	977.00	17,781,400
ビューティガレージ	3,100	2,596.00	8,047,600
ウイン・パートナーズ	13,900	1,010.00	14,039,000
ミタチ産業	4,900	931.00	4,561,900
シップヘルスケアホールディングス	57,500	2,388.00	137,310,000
明治電機工業	6,000	1,107.00	6,642,000
デリカフーズホールディングス	7,500	526.00	3,945,000
スターティアホールディングス	4,400	790.00	3,476,000
コメダホールディングス	41,900	2,300.00	96,370,000
ピーバンドットコム	2,800	548.00	1,534,400
アセンテック	6,600	730.00	4,818,000
富士興産	4,800	1,127.00	5,409,600
協栄産業	2,000	1,434.00	2,868,000
フルサト・マルカホールディングス	17,500	3,225.00	56,437,500
ヤマエグループホールディングス	11,500	1,205.00	13,857,500
小野建	17,700	1,401.00	24,797,700
南陽	3,700	1,844.00	6,822,800
佐島電機	12,000	1,170.00	14,040,000
エコートレーディング	4,100	591.00	2,423,100

伯東	11,700	2,841.00	33,239,700
コンドーテック	14,400	1,043.00	15,019,200
中山福	10,200	337.00	3,437,400
ナガイレーベン	23,900	1,907.00	45,577,300
三菱食品	18,500	3,080.00	56,980,000
松田産業	14,000	2,080.00	29,120,000
第一興商	36,500	4,000.00	146,000,000
メディカルホールディングス	187,600	1,790.00	335,804,000
S P K	7,600	1,382.00	10,503,200
萩原電気ホールディングス	6,800	2,073.00	14,096,400
アズワン	27,600	6,120.00	168,912,000
スズデン	6,200	2,020.00	12,524,000
尾家産業	4,700	876.00	4,117,200
シモジマ	11,800	953.00	11,245,400
ドウシシャ	18,100	1,532.00	27,729,200
小津産業	4,200	1,878.00	7,887,600
高速	10,600	1,554.00	16,472,400
たけびし	6,800	1,462.00	9,941,600
リックス	4,100	1,902.00	7,798,200
丸文	15,900	779.00	12,386,100
ハピネット	15,100	1,563.00	23,601,300
橋本総業ホールディングス	3,600	1,963.00	7,066,800
日本ライフライン	56,900	925.00	52,632,500
タカショー	14,900	813.00	12,113,700
I D O M	58,300	728.00	42,442,400
進和	11,400	2,161.00	24,635,400
エスケイジャパン	4,700	467.00	2,194,900
ダイトロン	7,700	2,000.00	15,400,000
シークス	25,500	1,043.00	26,596,500
田中商事	6,000	603.00	3,618,000
オーハシテクニカ	9,800	1,292.00	12,661,600
白銅	6,200	2,498.00	15,487,600
ダイコー通産	2,300	1,147.00	2,638,100
伊藤忠商事	1,215,500	3,844.00	4,672,382,000
丸紅	1,754,200	1,451.00	2,545,344,200
高島	2,700	2,439.00	6,585,300
長瀬産業	92,700	1,886.00	174,832,200
蝶理	10,700	1,954.00	20,907,800
豊田通商	178,600	5,060.00	903,716,000
三共生興	24,700	556.00	13,733,200
兼松	68,200	1,358.00	92,615,600
ツカモトコーポレーション	3,200	1,210.00	3,872,000

三井物産	1,425,200	3,459.00	4,929,766,800
日本紙パルプ商事	9,400	3,725.00	35,015,000
カメイ	21,300	1,080.00	23,004,000
東都水産	1,000	4,370.00	4,370,000
OUGホールディングス	2,800	2,800.00	7,840,000
スターゼン	13,400	1,951.00	26,143,400
山善	73,100	988.00	72,222,800
椿本興業	3,400	3,685.00	12,529,000
住友商事	1,161,700	1,961.00	2,278,093,700
内田洋行	7,800	5,300.00	41,340,000
三菱商事	1,319,300	4,733.00	6,244,246,900
第一実業	7,800	3,410.00	26,598,000
キャノンマーケティングジャパン	47,600	3,010.00	143,276,000
西華産業	8,700	1,636.00	14,233,200
佐藤商事	14,100	1,153.00	16,257,300
菱洋エレクトロ	11,400	2,332.00	26,584,800
東京産業	16,300	715.00	11,654,500
ユアサ商事	16,400	3,415.00	56,006,000
神鋼商事	4,300	3,875.00	16,662,500
トルク	10,400	204.00	2,121,600
阪和興業	35,000	2,999.00	104,965,000
正栄食品工業	12,400	3,965.00	49,166,000
カナデン	15,600	1,013.00	15,802,800
菱電商事	15,200	1,637.00	24,882,400
岩谷産業	43,700	5,560.00	242,972,000
ナイス	6,100	1,618.00	9,869,800
ニチモウ	2,500	2,455.00	6,137,500
極東貿易	5,500	2,676.00	14,718,000
アステナホールディングス	25,600	433.00	11,084,800
三愛オブリ	44,500	1,012.00	45,034,000
稲畑産業	38,500	2,325.00	89,512,500
G S Iクレオス	9,200	1,314.00	12,088,800
明和産業	17,800	712.00	12,673,600
クワザワホールディングス	7,200	470.00	3,384,000
ワキタ	36,800	1,149.00	42,283,200
東邦ホールディングス	55,300	1,925.00	106,452,500
サンゲツ	47,800	1,521.00	72,703,800
ミツウロコグループホールディングス	23,900	947.00	22,633,300
シナネンホールディングス	6,600	3,415.00	22,539,000
伊藤忠エネクス	42,500	1,078.00	45,815,000
サンリオ	55,700	2,600.00	144,820,000
サンワテクノス	10,400	1,454.00	15,121,600

リョーサン	20,200	2,350.00	47,470,000
新光商事	26,500	887.00	23,505,500
トーホー	7,800	1,224.00	9,547,200
三信電気	8,200	1,617.00	13,259,400
東陽テクニカ	19,000	1,105.00	20,995,000
モスフードサービス	25,200	3,010.00	75,852,000
加賀電子	16,200	3,080.00	49,896,000
ソーダニッカ	17,000	621.00	10,557,000
立花エレテック	13,300	1,561.00	20,761,300
フォーバル	7,300	885.00	6,460,500
PALTA C	26,900	4,265.00	114,728,500
三谷産業	30,100	316.00	9,511,600
西本Wismettacホールディングス	4,400	3,710.00	16,324,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	1,899.00	3,228,300
コア商事ホールディングス	12,000	834.00	10,008,000
国際紙パルプ商事	37,100	429.00	15,915,900
ヤマタネ	8,500	1,611.00	13,693,500
丸紅建材リース	1,700	1,912.00	3,250,400
日鉄物産	12,400	5,280.00	65,472,000
泉州電業	4,900	5,640.00	27,636,000
トラスコ中山	40,000	1,808.00	72,320,000
オートバックスセブン	61,300	1,383.00	84,777,900
モリト	14,000	764.00	10,696,000
加藤産業	23,100	3,075.00	71,032,500
北恵	4,900	897.00	4,395,300
イノテック	11,600	1,356.00	15,729,600
イエローハット	31,300	1,615.00	50,549,500
J Kホールディングス	14,200	936.00	13,291,200
日伝	14,000	1,972.00	27,608,000
北沢産業	11,300	217.00	2,452,100
杉本商事	9,000	2,223.00	20,007,000
因幡電機産業	49,000	2,695.00	132,055,000
東テク	5,900	2,905.00	17,139,500
ミスミグループ本社	241,100	2,977.00	717,754,700
アルテック	12,300	236.00	2,902,800
タキヒヨー	5,400	1,072.00	5,788,800
蔵王産業	3,700	1,999.00	7,396,300
スズケン	70,900	3,495.00	247,795,500
ジェコス	13,300	841.00	11,185,300
グローセル	21,400	408.00	8,731,200
ローソン	42,600	4,290.00	182,754,000
サンエー	13,700	4,000.00	54,800,000



カワチ薬品	15,100	2,061.00	31,121,100
エービーシー・マート	30,000	5,830.00	174,900,000
ハードオフコーポレーション	8,900	886.00	7,885,400
アスクル	43,700	1,502.00	65,637,400
ゲオホールディングス	24,300	1,246.00	30,277,800
アダストリア	20,900	2,162.00	45,185,800
くら寿司	20,200	3,070.00	62,014,000
キャンドウ	7,300	2,220.00	16,206,000
アイケイ	6,800	534.00	3,631,200
パルグループホールディングス	17,000	1,765.00	30,005,000
エディオン	88,500	1,178.00	104,253,000
サーラコーポレーション	39,600	640.00	25,344,000
ワッツ	9,800	733.00	7,183,400
ハローズ	8,900	3,240.00	28,836,000
フジオフードグループ本社	14,900	1,370.00	20,413,000
あみやき亭	4,700	2,920.00	13,724,000
大黒天物産	6,200	4,385.00	27,187,000
ハニーズホールディングス	16,100	1,172.00	18,869,200
ファーマライズホールディングス	4,800	719.00	3,451,200
アルペン	14,500	1,965.00	28,492,500
ハブ	6,900	615.00	4,243,500
クオールホールディングス	23,800	1,333.00	31,725,400
ジinzホールディングス	11,200	4,190.00	46,928,000
ビックカメラ	114,200	1,110.00	126,762,000
D C Mホールディングス	114,400	1,030.00	117,832,000
Monotaro	243,000	2,026.00	492,318,000
東京一番フーズ	5,200	591.00	3,073,200
きちりホールディングス	5,100	420.00	2,142,000
アーランドサービスホールディングス	14,200	2,128.00	30,217,600
J.フロント リテイリング	218,700	1,159.00	253,473,300
ドトール・日レスホールディングス	31,500	1,530.00	48,195,000
マツキヨココカラ&カンパニー	114,500	5,090.00	582,805,000
ブロンコビリー	10,500	2,448.00	25,704,000
Z O Z O	132,200	2,527.00	334,069,400
トレジャー・ファクトリー	6,000	1,129.00	6,774,000
物語コーポレーション	9,600	6,010.00	57,696,000
三越伊勢丹ホールディングス	304,600	1,146.00	349,071,600
Hamee	7,200	1,209.00	8,704,800
マーケットエンタープライズ	2,300	1,087.00	2,500,100
ウエルシアホールディングス	101,700	2,514.00	255,673,800
クリエイティブSDホールディングス	28,500	2,821.00	80,398,500
丸善CHIホールディングス	22,400	386.00	8,646,400

ミサワ	4,500	639.00	2,875,500
ティーライフ	2,900	1,391.00	4,033,900
チムニー	5,900	1,212.00	7,150,800
シュッピン	16,200	1,494.00	24,202,800
オイシックス・ラ・大地	27,800	1,815.00	50,457,000
ネクステージ	39,200	2,252.00	88,278,400
ジョイフル本田	58,000	1,606.00	93,148,000
鳥貴族ホールディングス	6,800	2,055.00	13,974,000
ホットランド	14,600	1,338.00	19,534,800
すかいらーくホールディングス	239,000	1,607.00	384,073,000
SFPホールディングス	9,400	1,570.00	14,758,000
綿半ホールディングス	13,900	1,321.00	18,361,900
ヨシックスホールディングス	3,900	2,353.00	9,176,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	56,200	1,047.00	58,841,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	10,200	1,463.00	14,922,600
BEENOS	9,900	2,133.00	21,116,700
あさひ	16,200	1,302.00	21,092,400
日本調剤	11,900	1,297.00	15,434,300
コスモス薬品	19,400	11,770.00	228,338,000
トーエル	9,100	878.00	7,989,800
セブン&アイ・ホールディングス	679,900	5,545.00	3,770,045,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	120,000	966.00	115,920,000
ツルハホールディングス	42,000	6,710.00	281,820,000
サンマルクホールディングス	15,400	1,556.00	23,962,400
フェリシモ	4,600	1,172.00	5,391,200
トリドールホールディングス	47,900	2,285.00	109,451,500
TOKYO BASE	18,700	347.00	6,488,900
ウイルプラスホールディングス	4,000	921.00	3,684,000
JMホールディングス	14,200	1,512.00	21,470,400
サツドラホールディングス	9,200	657.00	6,044,400
アレンザホールディングス	13,800	1,007.00	13,896,600
串カツ田中ホールディングス	5,300	1,873.00	9,926,900
パロックジャパンリミテッド	13,800	817.00	11,274,600
クスリのアオキホールディングス	17,900	5,420.00	97,018,000
力の源ホールディングス	9,800	715.00	7,007,000
FOOD & LIFE COMPANIES	103,200	3,080.00	317,856,000
メディカルシステムネットワーク	18,200	433.00	7,880,600
はるやまホールディングス	9,800	456.00	4,468,800
ノジマ	31,200	2,911.00	90,823,200
カッパ・クリエイト	26,900	1,407.00	37,848,300

ライトオン	14,400	751.00	10,814,400
良品計画	221,300	1,386.00	306,721,800
パリティホールディングス	25,200	270.00	6,804,000
アドヴァングループ	17,900	809.00	14,481,100
アルビス	6,000	2,208.00	13,248,000
コナカ	21,400	339.00	7,254,600
ハウス オブ ローゼ	2,600	1,680.00	4,368,000
G - 7ホールディングス	21,600	1,371.00	29,613,600
イオン北海道	28,300	1,080.00	30,564,000
コジマ	33,700	584.00	19,680,800
ヒマラヤ	6,600	951.00	6,276,600
コーナン商事	27,400	3,580.00	98,092,000
エコス	6,800	2,033.00	13,824,400
ワタミ	23,300	940.00	21,902,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	384,100	2,048.00	786,636,800
西松屋チェーン	39,600	1,461.00	57,855,600
ゼンショーホールディングス	93,900	3,030.00	284,517,000
幸楽苑ホールディングス	11,500	1,285.00	14,777,500
ハークスレイ	8,700	583.00	5,072,100
サイゼリヤ	28,600	2,618.00	74,874,800
V Tホールディングス	73,100	472.00	34,503,200
魚力	5,500	2,291.00	12,600,500
フジ・コーポレーション	10,500	1,217.00	12,778,500
ユナイテッドアローズ	20,300	2,100.00	42,630,000
ハイデイ日高	27,900	2,104.00	58,701,600
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	12,800	249.00	3,187,200
コロワイド	78,900	1,795.00	141,625,500
ピーシーデボコーポレーション	23,400	350.00	8,190,000
壱番屋	13,600	4,865.00	66,164,000
P L A N T	5,200	653.00	3,395,600
スギホールディングス	38,400	5,220.00	200,448,000
薬王堂ホールディングス	9,800	2,044.00	20,031,200
スクロール	30,000	862.00	25,860,000
ヨンドシーホールディングス	16,900	1,786.00	30,183,400
木曽路	25,900	2,098.00	54,338,200
S R Sホールディングス	27,800	856.00	23,796,800
千趣会	35,600	397.00	14,133,200
リテールパートナーズ	27,600	1,130.00	31,188,000
ケーヨー	35,700	945.00	33,736,500
上新電機	20,000	1,873.00	37,460,000
日本瓦斯	93,500	2,007.00	187,654,500

ロイヤルホールディングス	31,700	2,259.00	71,610,300
いなげや	20,800	1,192.00	24,793,600
チヨダ	17,700	742.00	13,133,400
ライフコーポレーション	16,100	2,601.00	41,876,100
リンガーハット	22,600	2,321.00	52,454,600
MrMaxHD	24,600	604.00	14,858,400
AOKIホールディングス	37,700	697.00	26,276,900
オークワ	28,600	853.00	24,395,800
コメリ	29,800	2,650.00	78,970,000
青山商事	38,100	911.00	34,709,100
しまむら	22,400	11,110.00	248,864,000
はせがわ	11,500	284.00	3,266,000
高島屋	132,900	1,359.00	180,611,100
松屋	34,600	963.00	33,319,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	86,100	1,059.00	91,179,900
近鉄百貨店	6,300	2,478.00	15,611,400
丸井グループ	143,300	2,444.00	350,225,200
アクシアル リテイリング	13,600	3,015.00	41,004,000
イオン	668,800	2,291.00	1,532,220,800
イズミ	31,900	2,953.00	94,200,700
平和堂	29,800	1,887.00	56,232,600
フジ	45,700	2,215.00	101,225,500
ヤオコー	21,800	6,250.00	136,250,000
ゼビオホールディングス	26,500	909.00	24,088,500
ケースホールディングス	168,300	1,253.00	210,879,900
Olympicグループ	9,500	703.00	6,678,500
日産東京販売ホールディングス	29,700	258.00	7,662,600
シルバーライフ	4,100	1,786.00	7,322,600
Genky DrugStores	8,500	3,340.00	28,390,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,700	907.00	4,262,900
ブックオフグループホールディングス	11,200	986.00	11,043,200
ギフトホールディングス	3,200	2,185.00	6,992,000
アインホールディングス	24,400	7,080.00	172,752,000
元気寿司	5,500	2,511.00	13,810,500
ヤマダホールディングス	699,800	471.00	329,605,800
アークランドサカモト	30,300	1,502.00	45,510,600
ニトリホールディングス	76,200	12,430.00	947,166,000
グルメ杵屋	15,600	1,014.00	15,818,400
愛眼	14,000	187.00	2,618,000
ケーユーホールディングス	10,400	1,078.00	11,211,200
吉野家ホールディングス	67,200	2,480.00	166,656,000
松屋フーズホールディングス	9,300	3,820.00	35,526,000

サガミホールディングス	28,500	1,150.00	32,775,000
関西フードマーケット	17,100	1,241.00	21,221,100
王将フードサービス	12,700	6,780.00	86,106,000
プレナス	21,700	1,933.00	41,946,100
ミニストップ	14,400	1,404.00	20,217,600
アークス	35,100	1,953.00	68,550,300
パローホールディングス	40,500	1,826.00	73,953,000
ベルク	8,600	5,170.00	44,462,000
大庄	10,600	1,170.00	12,402,000
ファーストリテイリング	25,700	69,180.00	1,777,926,000
サンドラッグ	72,400	2,890.00	209,236,000
サクスパー ホールディングス	18,800	576.00	10,828,800
ヤマザワ	4,400	1,512.00	6,652,800
やまや	3,900	2,500.00	9,750,000
ペルーナ	41,800	685.00	28,633,000
島根銀行	6,100	513.00	3,129,300
じもとホールディングス	13,000	580.00	7,540,000
めぶきフィナンシャルグループ	835,200	253.00	211,305,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,900	1,926.00	44,105,400
九州フィナンシャルグループ	355,400	394.00	140,027,600
ゆうちょ銀行	454,000	994.00	451,276,000
富山第一銀行	43,800	400.00	17,520,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,000,900	458.00	458,412,200
西日本フィナンシャルホールディングス	107,100	771.00	82,574,100
三十三フィナンシャルグループ	16,200	1,369.00	22,177,800
第四北越フィナンシャルグループ	28,500	2,516.00	71,706,000
ひろぎんホールディングス	258,500	608.00	157,168,000
おきなわフィナンシャルグループ	16,600	2,149.00	35,673,400
十六フィナンシャルグループ	23,500	2,283.00	53,650,500
北國フィナンシャルホールディングス	16,900	4,380.00	74,022,000
プロクレアホールディングス	19,900	1,917.00	38,148,300
新生銀行	125,500	1,966.00	246,733,000
あおぞら銀行	107,400	2,660.00	285,684,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,525,700	745.00	8,586,646,500
りそなホールディングス	2,083,500	500.00	1,041,750,000
三井住友トラスト・ホールディングス	333,300	4,037.00	1,345,532,100
三井住友フィナンシャルグループ	1,275,800	3,977.00	5,073,856,600
千葉銀行	576,100	714.00	411,335,400
群馬銀行	326,600	377.00	123,128,200
武蔵野銀行	25,900	1,764.00	45,687,600
千葉興業銀行	42,700	260.00	11,102,000
筑波銀行	75,000	187.00	14,025,000

七十七銀行	54,100	1,833.00	99,165,300
秋田銀行	11,800	1,578.00	18,620,400
山形銀行	18,700	865.00	16,175,500
岩手銀行	12,000	2,058.00	24,696,000
東邦銀行	145,200	201.00	29,185,200
東北銀行	8,800	990.00	8,712,000
ふくおかフィナンシャルグループ	146,600	2,425.00	355,505,000
静岡銀行	420,400	786.00	330,434,400
スルガ銀行	168,600	357.00	60,190,200
八十二銀行	392,000	468.00	183,456,000
山梨中央銀行	19,800	1,130.00	22,374,000
大垣共立銀行	34,600	1,720.00	59,512,000
福井銀行	15,700	1,328.00	20,849,600
清水銀行	7,200	1,495.00	10,764,000
富山銀行	3,100	1,902.00	5,896,200
滋賀銀行	32,900	2,658.00	87,448,200
南都銀行	27,300	1,960.00	53,508,000
百五銀行	169,200	322.00	54,482,400
京都銀行	62,800	5,970.00	374,916,000
紀陽銀行	59,800	1,360.00	81,328,000
ほくほくフィナンシャルグループ	111,700	822.00	91,817,400
山陰合同銀行	109,300	669.00	73,121,700
中国銀行	145,800	925.00	134,865,000
鳥取銀行	6,100	1,210.00	7,381,000
伊予銀行	228,700	640.00	146,368,000
百十四銀行	18,600	1,729.00	32,159,400
四国銀行	26,600	807.00	21,466,200
阿波銀行	26,800	2,013.00	53,948,400
大分銀行	10,600	1,792.00	18,995,200
宮崎銀行	10,900	2,063.00	22,486,700
佐賀銀行	10,400	1,431.00	14,882,400
琉球銀行	41,800	794.00	33,189,200
セブン銀行	571,200	247.00	141,086,400
みずほフィナンシャルグループ	2,357,200	1,506.00	3,549,943,200
高知銀行	6,400	759.00	4,857,600
山口フィナンシャルグループ	202,700	762.00	154,457,400
長野銀行	6,000	1,272.00	7,632,000
名古屋銀行	12,500	2,994.00	37,425,000
北洋銀行	257,700	217.00	55,920,900
愛知銀行	6,300	5,000.00	31,500,000
中京銀行	6,300	1,618.00	10,193,400
大光銀行	6,000	1,314.00	7,884,000

愛媛銀行	25,700	884.00	22,718,800
トマト銀行	6,200	1,022.00	6,336,400
京葉銀行	80,200	460.00	36,892,000
栃木銀行	88,500	265.00	23,452,500
北日本銀行	5,700	1,561.00	8,897,700
東和銀行	32,300	514.00	16,602,200
福島銀行	20,900	227.00	4,744,300
大東銀行	8,700	653.00	5,681,100
トモニホールディングス	142,100	312.00	44,335,200
フィデアホールディングス	17,600	1,266.00	22,281,600
池田泉州ホールディングス	209,800	194.00	40,701,200
F P G	65,000	933.00	60,645,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	15,100	1,390.00	20,989,000
マーキュリアホールディングス	9,900	607.00	6,009,300
S B Iホールディングス	237,600	2,633.00	625,600,800
ジャフコ グループ	73,600	1,623.00	119,452,800
大和証券グループ本社	1,372,200	619.90	850,626,780
野村ホールディングス	2,936,900	492.80	1,447,304,320
岡三証券グループ	143,600	340.00	48,824,000
丸三証券	57,700	483.00	27,869,100
東洋証券	61,300	186.00	11,401,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	200,500	374.00	74,987,000
光世証券	4,600	478.00	2,198,800
水戸証券	49,500	264.00	13,068,000
いちよし証券	34,700	646.00	22,416,200
松井証券	94,500	818.00	77,301,000
マネックスグループ	160,700	489.00	78,582,300
極東証券	23,500	681.00	16,003,500
岩井コスモホールディングス	18,400	1,244.00	22,889,600
アイザワ証券グループ	28,200	696.00	19,627,200
マネーパートナーズグループ	21,600	249.00	5,378,400
スパークス・グループ	89,800	253.00	22,719,400
かんぽ生命保険	193,600	2,190.00	423,984,000
S O M P Oホールディングス	287,700	5,961.00	1,714,979,700
アニコム ホールディングス	59,100	656.00	38,769,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	407,300	4,115.00	1,676,039,500
第一生命ホールディングス	915,700	2,598.00	2,378,988,600
東京海上ホールディングス	562,700	7,572.00	4,260,764,400
T & Dホールディングス	451,700	1,579.00	713,234,300
アドバンスクリエイト	9,200	968.00	8,905,600
全国保証	46,000	4,275.00	196,650,000
あんしん保証	9,300	274.00	2,548,200

イントラスト	8,900	557.00	4,957,300
日本モーゲージサービス	11,100	964.00	10,700,400
C a s a	7,300	843.00	6,153,900
アルヒ	28,800	987.00	28,425,600
プレミアグループ	9,800	3,865.00	37,877,000
ネットプロテクションズホールディングス	59,100	571.00	33,746,100
クレディセゾン	116,300	1,538.00	178,869,400
芙蓉総合リース	17,800	7,740.00	137,772,000
みずほリース	25,900	3,150.00	81,585,000
東京センチュリー	32,400	4,250.00	137,700,000
日本証券金融	76,100	880.00	66,968,000
アイフル	324,000	347.00	112,428,000
リコーリース	17,200	3,455.00	59,426,000
イオンフィナンシャルサービス	105,000	1,240.00	130,200,000
アコム	380,800	315.00	119,952,000
ジャックス	20,000	3,360.00	67,200,000
オリエントコーポレーション	523,800	125.00	65,475,000
オリックス	1,142,800	2,421.50	2,767,290,200
三菱HCキャピタル	652,000	628.00	409,456,000
九州リースサービス	9,400	579.00	5,442,600
日本取引所グループ	458,900	2,105.50	966,213,950
イー・ギャランティ	28,600	1,972.00	56,399,200
アサックス	10,700	601.00	6,430,700
NECキャピタルソリューション	8,000	1,970.00	15,760,000
いちご	219,900	302.00	66,409,800
日本駐車場開発	208,000	171.00	35,568,000
スター・マイカ・ホールディングス	11,600	1,593.00	18,478,800
SREホールディングス	5,900	2,179.00	12,856,100
ADワークスグループ	36,200	154.00	5,574,800
ヒューリック	433,600	1,098.00	476,092,800
三栄建築設計	8,800	1,647.00	14,493,600
野村不動産ホールディングス	100,000	3,375.00	337,500,000
三重交通グループホールディングス	42,700	501.00	21,392,700
サムティ	30,000	2,020.00	60,600,000
ディア・ライフ	27,400	549.00	15,042,600
地主	13,000	2,024.00	26,312,000
プレサンスコーポレーション	23,500	1,526.00	35,861,000
ハウスコム	5,000	1,026.00	5,130,000
JPMC	11,000	1,032.00	11,352,000
サンセイランディック	7,700	872.00	6,714,400
フージャースホールディングス	24,600	827.00	20,344,200
オープンハウスグループ	61,500	5,410.00	332,715,000



東急不動産ホールディングス	540,000	696.00	375,840,000
飯田グループホールディングス	161,300	2,017.00	325,342,100
イーランド	4,100	1,509.00	6,186,900
ムゲンエステート	15,500	495.00	7,672,500
A n d D oホールディングス	9,500	904.00	8,588,000
シーアールイー	7,800	1,595.00	12,441,000
ケイアイスター不動産	9,000	4,775.00	42,975,000
グッドコムアセット	9,800	1,184.00	11,603,200
ジェイ・エス・ビー	4,400	3,390.00	14,916,000
ロードスターキャピタル	6,200	1,509.00	9,355,800
テンポイノベーション	7,500	850.00	6,375,000
フェイスネットワーク	3,800	1,363.00	5,179,400
パーク24	114,800	2,114.00	242,687,200
パラカ	6,400	1,793.00	11,475,200
三井不動産	794,500	2,932.00	2,329,474,000
三菱地所	1,152,300	1,994.00	2,297,686,200
平和不動産	31,800	3,955.00	125,769,000
東京建物	174,100	1,772.00	308,505,200
京阪神ビルディング	28,100	1,282.00	36,024,200
住友不動産	365,600	3,693.00	1,350,160,800
テオーシー	33,700	633.00	21,332,100
東京楽天地	3,400	4,010.00	13,634,000
スターツコーポレーション	26,900	2,576.00	69,294,400
フジ住宅	25,100	646.00	16,214,600
空港施設	22,700	542.00	12,303,400
明和地所	12,100	622.00	7,526,200
ゴールドクレスト	16,200	1,713.00	27,750,600
エスリード	8,500	1,692.00	14,382,000
日神グループホールディングス	35,300	446.00	15,743,800
日本エスコン	35,800	769.00	27,530,200
タカラレーベン	80,600	344.00	27,726,400
A V A N T I A	11,500	846.00	9,729,000
イオンモール	97,500	1,651.00	160,972,500
毎日コムネット	9,200	681.00	6,265,200
ファースト住建	8,800	1,111.00	9,776,800
カチタス	48,200	2,969.00	143,105,800
トーセイ	28,100	1,176.00	33,045,600
穴吹興産	5,000	2,363.00	11,815,000
サンフロンティア不動産	28,200	1,082.00	30,512,400
F Jネクストホールディングス	20,600	1,081.00	22,268,600
インテリックス	4,300	610.00	2,623,000
ランドビジネス	7,000	237.00	1,659,000

サンネクスタグループ	7,700	1,174.00	9,039,800
グランディハウス	16,500	538.00	8,877,000
日本空港ビルデング	66,100	5,420.00	358,262,000
明豊ファシリティワークス	9,100	660.00	6,006,000
日本工営	12,000	3,300.00	39,600,000
L I F U L L	59,000	171.00	10,089,000
ミクシィ	42,800	2,187.00	93,603,600
ジェイエイシーリクルートメント	15,200	1,727.00	26,250,400
日本M&Aセンターホールディングス	305,900	1,397.00	427,342,300
メンバーズ	5,200	2,785.00	14,482,000
中広	3,900	386.00	1,505,400
UTグループ	27,000	2,442.00	65,934,000
アイティメディア	9,000	1,690.00	15,210,000
E・Jホールディングス	11,000	1,152.00	12,672,000
夢真ビーネックスグループ	61,000	1,430.00	87,230,000
コシダカホールディングス	50,300	800.00	40,240,000
アルトナー	5,000	853.00	4,265,000
パソナグループ	20,400	1,982.00	40,432,800
C D S	4,800	1,959.00	9,403,200
リンクアンドモチベーション	41,100	450.00	18,495,000
エス・エム・エス	63,400	2,830.00	179,422,000
サニーサイドアップグループ	7,000	612.00	4,284,000
パーソルホールディングス	186,400	2,406.00	448,478,400
リニカル	10,900	815.00	8,883,500
クックパッド	60,200	222.00	13,364,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,700	618.00	5,994,600
学情	7,900	975.00	7,702,500
スタジオアリス	8,500	2,274.00	19,329,000
シミックホールディングス	9,800	1,455.00	14,259,000
エプコ	4,400	761.00	3,348,400
N J S	4,300	2,036.00	8,754,800
総合警備保障	70,100	3,505.00	245,700,500
カカクコム	136,900	2,330.00	318,977,000
アイロムグループ	6,700	1,894.00	12,689,800
セントケア・ホールディング	12,500	844.00	10,550,000
サイネックス	3,800	595.00	2,261,000
ルネサンス	13,300	956.00	12,714,800
ディップ	32,900	3,710.00	122,059,000
デジタルホールディングス	13,300	1,316.00	17,502,800
新日本科学	22,900	1,929.00	44,174,100
キャリアデザインセンター	4,500	1,112.00	5,004,000
ベネフィット・ワン	68,000	1,856.00	126,208,000

エムスリー	328,900	3,908.00	1,285,341,200
ツカダ・グローバルホールディング	11,900	363.00	4,319,700
アウトソーシング	107,100	1,124.00	120,380,400
ウェルネット	18,000	510.00	9,180,000
ワールドホールディングス	7,600	2,383.00	18,110,800
ディー・エヌ・エー	71,200	1,849.00	131,648,800
博報堂DYホールディングス	244,000	1,282.00	312,808,000
ぐるなび	29,200	430.00	12,556,000
タカミヤ	23,500	382.00	8,977,000
ジャパンベストレスキューシステム	11,200	785.00	8,792,000
ファンコミュニケーションズ	44,400	401.00	17,804,400
ライク	6,400	2,128.00	13,619,200
ビジネス・ブレークスルー	7,700	442.00	3,403,400
エスプール	52,900	1,229.00	65,014,100
WDBホールディングス	8,700	2,304.00	20,044,800
ティア	11,700	444.00	5,194,800
C D G	2,300	1,282.00	2,948,600
アドウェイズ	28,400	719.00	20,419,600
バリューコマース	14,700	3,260.00	47,922,000
インフォマート	205,000	456.00	93,480,000
J Pホールディングス	49,500	226.00	11,187,000
エコナックホールディングス	36,600	92.00	3,367,200
C Lホールディングス	4,300	1,010.00	4,343,000
プレステージ・インターナショナル	70,400	668.00	47,027,200
アミューズ	10,300	2,079.00	21,413,700
ドリームインキュベータ	5,600	2,311.00	12,941,600
クイック	12,200	1,437.00	17,531,400
T A C	11,700	227.00	2,655,900
電通グループ	180,500	4,375.00	789,687,500
イオンファンタジー	7,300	2,638.00	19,257,400
シーティーエス	21,500	853.00	18,339,500
ネクシィーズグループ	6,700	553.00	3,705,100
H . U . グループホールディングス	48,800	2,712.00	132,345,600
アルプス技研	15,600	1,865.00	29,094,000
ダイオーズ	4,000	1,151.00	4,604,000
日本空調サービス	20,000	795.00	15,900,000
オリエンタルランド	205,500	18,635.00	3,829,492,500
ダスキン	41,300	2,699.00	111,468,700
明光ネットワークジャパン	22,500	600.00	13,500,000
ファルコホールディングス	8,600	2,054.00	17,664,400
ラウンドワン	52,300	1,692.00	88,491,600
リゾートトラスト	81,200	2,178.00	176,853,600

ビー・エム・エル	23,800	3,545.00	84,371,000
りらいあコミュニケーションズ	27,800	1,068.00	29,690,400
リソー教育	86,200	333.00	28,704,600
早稲田アカデミー	10,700	1,130.00	12,091,000
ユー・エス・エス	208,800	2,425.00	506,340,000
東京個別指導学院	17,100	603.00	10,311,300
サイバーエージェント	418,700	1,405.00	588,273,500
楽天グループ	896,100	713.00	638,919,300
クリーク・アンド・リバー社	9,900	2,012.00	19,918,800
モーニングスター	33,300	521.00	17,349,300
テー・オー・ダブリュー	36,700	333.00	12,221,100
山田コンサルティンググループ	10,000	1,141.00	11,410,000
セントラルスポーツ	7,100	2,422.00	17,196,200
フルキャストホールディングス	16,100	2,161.00	34,792,100
エン・ジャパン	32,300	1,812.00	58,527,600
リソルホールディングス	2,100	4,715.00	9,901,500
テクノプロ・ホールディングス	111,700	2,930.00	327,281,000
アトラグループ	4,100	204.00	836,400
インターワークス	6,300	383.00	2,412,900
アイ・アールジャパンホールディングス	8,800	2,218.00	19,518,400
Keeper 技研	12,100	3,425.00	41,442,500
ファーストロジック	3,600	774.00	2,786,400
三機サービス	3,600	1,022.00	3,679,200
Gunosy	10,700	921.00	9,854,700
デザインワン・ジャパン	7,300	179.00	1,306,700
イー・ガーディアン	6,800	2,969.00	20,189,200
リブセンス	12,500	167.00	2,087,500
ジャパンマテリアル	57,500	1,880.00	108,100,000
ベクトル	26,500	1,044.00	27,666,000
ウチヤマホールディングス	10,400	303.00	3,151,200
チャーム・ケア・コーポレーション	14,200	1,010.00	14,342,000
キャリアリンク	7,100	1,836.00	13,035,600
I B J	15,800	715.00	11,297,000
アサンテ	8,500	1,522.00	12,937,000
バリューHR	16,000	1,255.00	20,080,000
M&Aキャピタルパートナーズ	15,500	3,300.00	51,150,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,500	1,202.00	9,015,000
E R Iホールディングス	5,500	1,539.00	8,464,500
アビスト	3,000	2,877.00	8,631,000
シグマクシス・ホールディングス	22,800	1,090.00	24,852,000
ウィルグループ	14,200	1,152.00	16,358,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	23,400	176.00	4,118,400

メドピア	13,700	2,091.00	28,646,700
レアジョブ	4,200	601.00	2,524,200
リクルートホールディングス	1,369,100	4,448.00	6,089,756,800
エラン	26,000	1,016.00	26,416,000
土木管理総合試験所	9,700	334.00	3,239,800
ネットマーケティング	9,600	628.00	6,028,800
日本郵政	2,230,900	956.80	2,134,525,120
ベルシステム24ホールディングス	27,000	1,390.00	37,530,000
鎌倉新書	21,900	553.00	12,110,700
S MN	4,700	600.00	2,820,000
グローバルキッズCOMPANY	3,600	667.00	2,401,200
エアトリ	11,300	2,846.00	32,159,800
アトラエ	13,200	1,770.00	23,364,000
ストライク	7,900	3,675.00	29,032,500
ソラスト	46,300	695.00	32,178,500
セラク	6,200	1,181.00	7,322,200
インソース	19,900	2,238.00	44,536,200
ベikalレント・コンサルティング	13,200	35,500.00	468,600,000
Orchestra Holdings	3,700	2,642.00	9,775,400
アイモバイル	8,200	1,418.00	11,627,600
キャリアインデックス	7,100	509.00	3,613,900
MS - Japan	8,000	894.00	7,152,000
船場	4,300	676.00	2,906,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	59,300	1,507.00	89,365,100
フルテック	2,900	1,333.00	3,865,700
GameWith	6,300	500.00	3,150,000
MS&Consulting	3,200	721.00	2,307,200
ウェルビー	12,700	794.00	10,083,800
エル・ティー・エス	2,500	3,515.00	8,787,500
ミダックホールディングス	8,500	2,695.00	22,907,500
日総工産	15,200	607.00	9,226,400
キュービーネットホールディングス	8,900	1,323.00	11,774,700
RPAホールディングス	27,200	397.00	10,798,400
スプリックス	6,400	1,018.00	6,515,200
マネジメントソリューションズ	9,200	3,840.00	35,328,000
プロレド・パートナーズ	4,700	577.00	2,711,900
テノ・ホールディングス	2,800	680.00	1,904,000
フロンティア・マネジメント	5,100	1,284.00	6,548,400
ピアラ	3,500	762.00	2,667,000
コプロ・ホールディングス	4,000	940.00	3,760,000
ギークス	3,600	977.00	3,517,200
カーブスホールディングス	51,700	685.00	35,414,500

フォーラムエンジニアリング	12,200	936.00	11,419,200	
Fast Fitness Japan	3,600	1,490.00	5,364,000	
ダイレクトマーケティングミックス	20,000	1,812.00	36,240,000	
ポピンズ	4,500	2,130.00	9,585,000	
LITALICO	15,200	2,616.00	39,763,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	10,200	483.00	4,926,600	
リログループ	102,100	2,105.00	214,920,500	
東祥	14,200	1,351.00	19,184,200	
ビーウィズ	5,200	1,390.00	7,228,000	
TREホールディングス	32,000	1,969.00	63,008,000	
人・夢・技術グループ	7,600	2,453.00	18,642,800	
エイチ・アイ・エス	39,800	2,220.00	88,356,000	
ラックランド	5,700	2,985.00	17,014,500	
共立メンテナンス	33,300	5,020.00	167,166,000	
イチネンホールディングス	19,400	1,219.00	23,648,600	
建設技術研究所	10,100	2,581.00	26,068,100	
スペース	12,900	916.00	11,816,400	
燦ホールディングス	8,300	1,815.00	15,064,500	
スバル興業	1,200	8,780.00	10,536,000	
東京テアトル	7,000	1,232.00	8,624,000	
タナベ経営	7,700	683.00	5,259,100	
ナガワ	5,500	8,700.00	47,850,000	
東京都競馬	14,000	3,805.00	53,270,000	
カナモト	31,500	2,030.00	63,945,000	
西尾レントオール	16,200	2,847.00	46,121,400	
トランス・コスモス	23,700	3,515.00	83,305,500	
乃村工藝社	80,300	914.00	73,394,200	
藤田観光	8,100	2,941.00	23,822,100	
KNT-CTホールディングス	11,600	1,735.00	20,126,000	
日本管財	20,100	2,570.00	51,657,000	
トーカイ	15,500	1,667.00	25,838,500	
セコム	183,700	8,521.00	1,565,307,700	
セントラル警備保障	9,100	2,248.00	20,456,800	
丹青社	36,600	838.00	30,670,800	
メイテック	22,200	6,900.00	153,180,000	
応用地質	19,000	1,801.00	34,219,000	
船井総研ホールディングス	36,200	2,111.00	76,418,200	
進学会ホールディングス	7,100	355.00	2,520,500	
オオバ	12,500	774.00	9,675,000	
いであ	4,900	1,796.00	8,800,400	
学究社	6,200	1,578.00	9,783,600	
ベネッセホールディングス	62,300	2,069.00	128,898,700	

イオンディライト	21,600	2,850.00	61,560,000	
ナック	9,200	955.00	8,786,000	
ダイセキ	34,000	4,820.00	163,880,000	
ステップ	7,000	1,742.00	12,194,000	
合 計	203,059,600		497,588,133,070	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	609,257,010
国債証券	522,098,051,850
地方債証券	33,422,035,675
特殊債券	36,538,889,408
社債券	30,063,169,180
未収入金	298,949,000
未収利息	1,329,345,567
前払費用	35,488,405
流動資産合計	624,395,186,095
資産合計	624,395,186,095
負債の部	
流動負債	
未払金	302,314,000
未払解約金	363,974,982
未払利息	695
流動負債合計	666,289,677
負債合計	666,289,677
純資産の部	
元本等	
元本	452,471,725,809
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	171,257,170,609
元本等合計	623,728,896,418
純資産合計	623,728,896,418

	2022年 6月10日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	624,395,186,095

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 6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 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	452,471,725,809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 100,258,000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 1.3785円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,785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 6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 6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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月11日
期首元本額	445,819,467,688円
期中追加設定元本額	62,645,873,618円
期中一部解約元本額	55,993,615,497円
期末元本額	452,471,725,809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）	4,043,617,602円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,491,514円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,855,592,236円
世界経済インデックスファンド	3,750,568,716円
D C マイセレクション 2 5	25,767,560,148円
D C マイセレクション 5 0	29,494,524,157円
D C マイセレクション 7 5	8,604,551,246円
D C 日本債券インデックス・オープン	432,043,330円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,325,225,741円
D C 日本債券インデックス・オープン P	66,512,711,651円
D C マイセレクション S 2 5	12,997,175,379円
D C マイセレクション S 5 0	14,449,691,128円
D C マイセレクション S 7 5	3,280,975,521円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	795,026,919円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,201,842,909円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	820,572,664円
D C 世界経済インデックスファンド	3,360,399,235円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,435,383円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	28,573,508円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	9,959,214円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	972,063円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	92,634,852円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	126,903,788円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	33,015,046円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	26,734,427円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,913,273,360円

区分	2022年 6月10日現在
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	760,830,944円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,174,395,314円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	86,733,255円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	55,723,462円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	997,691,641円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,148,720,652円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,434,233,745円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	138,892,386円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,042,755,457円
日本債券ファンド・シリーズ1	16,389,888,010円
分散投資コア戦略ファンドA	19,869,312,536円
分散投資コア戦略ファンドS	25,440,115,400円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	161,350,824円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,357,742,213円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	66,338,036円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	37,789,794円
SMT インデックスバランス・オープン	61,389,813円
SMT 世界経済インデックス・オープン	36,996,571円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	72,733,801円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	115,290,275円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,781,376円
グローバル経済コア	230,030,198円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	30,660,478円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	19,516,131円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	22,848,144円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	12,252,739円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	3,405,289円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2,315,801円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	362,771円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	81,286,715,031円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	85,692,594円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	12,959,872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）	361,962,279円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 6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	2,359,362,000
地方債証券	89,274,405
特殊債券	76,697,550

社債券	76,812,200
合計	2,602,146,155

(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4 2 6 回利付国債(2年)	620,000,000	620,651,000	
	第4 2 7 回利付国債(2年)	3,260,000,000	3,263,683,800	
	第4 2 8 回利付国債(2年)	230,000,000	230,280,600	
	第4 2 9 回利付国債(2年)	950,000,000	951,168,500	
	第4 3 0 回利付国債(2年)	1,590,000,000	1,592,082,900	
	第4 3 4 回利付国債(2年)	1,915,000,000	1,917,949,100	
	第4 3 5 回利付国債(2年)	3,120,000,000	3,125,054,400	
	第4 3 6 回利付国債(2年)	720,000,000	721,216,800	
	第1 3 7 回利付国債(5年)	6,760,000,000	6,776,291,600	
	第1 3 8 回利付国債(5年)	6,890,000,000	6,909,360,900	
	第1 3 9 回利付国債(5年)	5,590,000,000	5,608,279,300	
	第1 4 0 回利付国債(5年)	4,660,000,000	4,677,428,400	
	第1 4 1 回利付国債(5年)	7,750,000,000	7,781,697,500	
	第1 4 2 回利付国債(5年)	4,370,000,000	4,389,839,800	
	第1 4 3 回利付国債(5年)	4,910,000,000	4,933,813,500	
	第1 4 4 回利付国債(5年)	6,310,000,000	6,342,433,400	
	第1 4 5 回利付国債(5年)	5,750,000,000	5,781,050,000	
	第1 4 6 回利付国債(5年)	3,150,000,000	3,167,766,000	
	第1 4 7 回利付国債(5年)	4,170,000,000	4,178,631,900	
	第1 4 8 回利付国債(5年)	6,950,000,000	6,962,579,500	
	第1 4 9 回利付国債(5年)	5,130,000,000	5,137,643,700	
	第1 5 0 回利付国債(5年)	7,880,000,000	7,888,904,400	

第151回利付国債（5年）	4,000,000,000	4,001,880,000	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	527,704,000	
第2回利付国債（40年）	1,130,000,000	1,440,648,300	
第3回利付国債（40年）	550,000,000	706,480,500	
第4回利付国債（40年）	950,000,000	1,219,667,000	
第5回利付国債（40年）	1,070,000,000	1,321,503,500	
第6回利付国債（40年）	1,260,000,000	1,528,606,800	
第7回利付国債（40年）	1,240,000,000	1,444,029,600	
第8回利付国債（40年）	1,230,000,000	1,334,943,600	
第9回利付国債（40年）	2,050,000,000	1,647,974,500	
第10回利付国債（40年）	2,100,000,000	1,979,439,000	
第11回利付国債（40年）	1,635,000,000	1,489,959,150	
第12回利付国債（40年）	1,290,000,000	1,055,581,200	
第13回利付国債（40年）	2,140,000,000	1,741,617,600	
第14回利付国債（40年）	2,130,000,000	1,853,100,000	
第15回利付国債（40年）	230,000,000	219,387,800	
第330回利付国債（10年）	3,910,000,000	3,954,261,200	
第331回利付国債（10年）	900,000,000	907,902,000	
第332回利付国債（10年）	4,800,000,000	4,850,016,000	
第333回利付国債（10年）	3,030,000,000	3,066,723,600	
第334回利付国債（10年）	4,260,000,000	4,319,001,000	
第335回利付国債（10年）	2,310,000,000	2,340,468,900	
第336回利付国債（10年）	1,110,000,000	1,126,250,400	
第337回利付国債（10年）	2,800,000,000	2,826,852,000	
第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	4,620,055,200	
第339回利付国債（10年）	4,750,000,000	4,817,545,000	
第340回利付国債（10年）	4,830,000,000	4,903,609,200	
第341回利付国債（10年）	5,340,000,000	5,407,818,000	
第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	4,786,941,600	
第343回利付国債（10年）	2,670,000,000	2,685,032,100	
第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	5,932,745,000	
第345回利付国債（10年）	3,780,000,000	3,800,487,600	
第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,778,750,000	
第347回利付国債（10年）	3,850,000,000	3,868,326,000	
第348回利付国債（10年）	4,340,000,000	4,357,099,600	
第349回利付国債（10年）	5,000,000,000	5,016,500,000	
第350回利付国債（10年）	6,630,000,000	6,647,105,400	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	4,940,000,000	4,947,360,600	
第352回利付国債（10年）	4,510,000,000	4,512,796,200	
第353回利付国債（10年）	5,415,000,000	5,413,213,050	
第354回利付国債（10年）	4,790,000,000	4,783,533,500	
第355回利付国債（10年）	3,710,000,000	3,699,649,100	

第356回利付国債(10年)	4,080,000,000	4,059,477,600	
第357回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,751,496,400	
第358回利付国債(10年)	3,560,000,000	3,531,413,200	
第359回利付国債(10年)	3,420,000,000	3,388,980,600	
第360回利付国債(10年)	4,890,000,000	4,838,361,600	
第361回利付国債(10年)	3,940,000,000	3,893,941,400	
第362回利付国債(10年)	3,790,000,000	3,742,814,500	
第363回利付国債(10年)	5,460,000,000	5,390,112,000	
第364回利付国債(10年)	5,110,000,000	5,042,803,500	
第365回利付国債(10年)	6,670,000,000	6,579,955,000	
第366回利付国債(10年)	3,410,000,000	3,393,734,300	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	130,872,500	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	186,872,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	139,736,400	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	134,478,300	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	58,648,500	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	420,353,500	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	215,976,600	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	403,980,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	267,196,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	173,259,200	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	298,347,400	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	226,668,100	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	473,612,000	
第14回利付国債(30年)	800,000,000	985,904,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	423,823,600	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	250,004,000	
第17回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,426,782,000	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	424,619,100	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	653,802,700	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	605,500,800	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	619,075,000	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	683,953,200	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	545,885,000	
第24回利付国債(30年)	780,000,000	992,425,200	
第25回利付国債(30年)	600,000,000	747,720,000	
第26回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,755,597,800	
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,459,577,600	
第28回利付国債(30年)	2,090,000,000	2,685,190,200	
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,125,058,300	
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,230,093,800	
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,370,061,000	

第32回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,718,781,600
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,210,426,400
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,243,480,750
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	2,800,572,000
第36回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,599,515,900
第37回利付国債(30年)	2,225,000,000	2,677,587,250
第38回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,671,512,700
第39回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,784,169,600
第40回利付国債(30年)	1,380,000,000	1,636,804,200
第41回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,341,245,000
第42回利付国債(30年)	1,120,000,000	1,306,860,800
第43回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,562,842,000
第44回利付国債(30年)	1,210,000,000	1,411,852,200
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,621,512,000
第46回利付国債(30年)	1,990,000,000	2,240,998,700
第47回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,788,680,400
第48回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,887,207,300
第49回利付国債(30年)	1,700,000,000	1,875,916,000
第50回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,549,757,100
第51回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,479,594,600
第52回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,520,383,200
第53回利付国債(30年)	1,320,000,000	1,220,828,400
第54回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,661,606,000
第55回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,387,915,200
第56回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,423,153,200
第57回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,352,655,300
第58回利付国債(30年)	2,350,000,000	2,249,091,000
第59回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,314,514,800
第60回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,491,948,900
第61回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,352,587,800
第62回利付国債(30年)	480,000,000	421,315,200
第63回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,387,993,900
第64回利付国債(30年)	1,830,000,000	1,554,731,400
第65回利付国債(30年)	1,505,000,000	1,279,731,600
第66回利付国債(30年)	1,030,000,000	875,706,000
第67回利付国債(30年)	1,865,000,000	1,665,277,150
第68回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,327,902,900
第69回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,226,287,600
第70回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,587,906,600
第71回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,302,730,000
第72回利付国債(30年)	1,070,000,000	974,149,400
第73回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,701,400,800
第74回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,245,704,900

第64回利付国債(20年)	320,000,000	328,102,400	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	226,648,400	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	339,467,700	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	134,566,900	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	197,681,700	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	405,077,400	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	420,104,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	209,242,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	661,248,000	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	378,910,800	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	211,010,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	137,840,300	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	284,785,200	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	306,683,700	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	180,132,000	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	286,907,400	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	234,443,000	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	416,399,100	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	642,582,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	312,098,000	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	504,154,900	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	313,530,600	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	555,231,900	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,985,403,600	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	459,564,000	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	381,559,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	690,083,100	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	494,838,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	964,409,600	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	449,196,000	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	671,225,700	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	680,247,600	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,757,140,800	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	445,796,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	488,061,200	
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,436,376,300	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	539,188,800	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	811,389,150	
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,435,959,000	
第103回利付国債(20年)	400,000,000	453,464,000	
第104回利付国債(20年)	160,000,000	179,467,200	
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,328,314,200	



第106回利付国債(20年)	380,000,000	430,133,400
第107回利付国債(20年)	260,000,000	293,685,600
第108回利付国債(20年)	660,000,000	736,956,000
第109回利付国債(20年)	520,000,000	582,327,200
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,246,619,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,109,660,600
第112回利付国債(20年)	790,000,000	898,245,800
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,301,648,600
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,661,931,800
第115回利付国債(20年)	700,000,000	804,916,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,719,221,600
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,237,885,200
第118回利付国債(20年)	660,000,000	753,462,600
第119回利付国債(20年)	530,000,000	596,689,900
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,742,778,500
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,705,395,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,061,072,000
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,163,122,500
第124回利付国債(20年)	610,000,000	700,517,900
第125回利付国債(20年)	1,770,000,000	2,069,643,300
第126回利付国債(20年)	730,000,000	841,040,300
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,166,380,200
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,113,123,500
第129回利付国債(20年)	740,000,000	842,652,800
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,468,125,350
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,133,440,000
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,318,247,200
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,409,247,900
第134回利付国債(20年)	830,000,000	953,562,100
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,173,509,900
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,638,195,500
第137回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,210,223,200
第138回利付国債(20年)	620,000,000	695,745,400
第139回利付国債(20年)	830,000,000	939,518,500
第140回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,767,221,600
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,831,248,000
第142回利付国債(20年)	980,000,000	1,131,645,200
第143回利付国債(20年)	1,920,000,000	2,180,332,800
第144回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,293,934,000
第145回利付国債(20年)	2,675,000,000	3,069,535,750
第146回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,101,949,000
第147回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,653,986,500
第148回利付国債(20年)	2,000,000,000	2,257,380,000

第149回利付国債（20年）	2,900,000,000	3,275,202,000	
第150回利付国債（20年）	2,730,000,000	3,052,877,100	
第151回利付国債（20年）	2,255,000,000	2,468,616,150	
第152回利付国債（20年）	2,860,000,000	3,130,298,600	
第153回利付国債（20年）	2,440,000,000	2,701,714,400	
第154回利付国債（20年）	2,790,000,000	3,053,961,900	
第155回利付国債（20年）	2,800,000,000	2,990,540,000	
第156回利付国債（20年）	2,620,000,000	2,587,905,000	
第157回利付国債（20年）	2,950,000,000	2,828,489,500	
第158回利付国債（20年）	2,530,000,000	2,523,270,200	
第159回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,503,386,400	
第160回利付国債（20年）	1,890,000,000	1,931,353,200	
第161回利付国債（20年）	1,990,000,000	2,001,024,600	
第162回利付国債（20年）	630,000,000	632,205,000	
第163回利付国債（20年）	2,180,000,000	2,183,095,600	
第164回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,299,104,400	
第165回利付国債（20年）	2,150,000,000	2,110,848,500	
第166回利付国債（20年）	1,820,000,000	1,838,800,600	
第167回利付国債（20年）	2,150,000,000	2,100,313,500	
第168回利付国債（20年）	1,410,000,000	1,351,583,700	
第169回利付国債（20年）	1,990,000,000	1,870,361,200	
第170回利付国債（20年）	2,390,000,000	2,239,238,800	
第171回利付国債（20年）	1,670,000,000	1,559,663,100	
第172回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,283,113,500	
第173回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,219,434,000	
第174回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,334,870,400	
第175回利付国債（20年）	2,030,000,000	1,941,146,900	
第176回利付国債（20年）	2,850,000,000	2,717,133,000	
第177回利付国債（20年）	2,390,000,000	2,232,164,400	
第178回利付国債（20年）	1,690,000,000	1,605,331,000	
第179回利付国債（20年）	3,015,000,000	2,859,848,100	
第180回利付国債（20年）	1,820,000,000	1,823,094,000	
国債証券合計	504,745,000,000	522,098,051,850	
地方債証券			
第2回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（5年））	100,000,000	100,203,000	
第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	103,984,000	
第5回東京都公募公債（東京グリーンボンド（30年））	100,000,000	90,232,000	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	105,517,000	
第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	125,859,000	
第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	123,482,000	
第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	119,522,000	
第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	117,581,000	

第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	223,406,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,219,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,182,000	
第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	90,260,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	227,692,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	226,652,000	
第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,894,000	
第726回東京都公募公債	200,000,000	202,216,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	100,986,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	101,215,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	100,689,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,475,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	299,817,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	197,046,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,667,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,146,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,798,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	199,868,000	
第29回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	100,930,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	257,928,000	
第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,893,000	
第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	226,796,000	
第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,677,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,516,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,970,000	
第78回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	200,004,000	
第201回神奈川県公募公債	200,250,000	202,042,237	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	202,254,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	101,449,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,598,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,618,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,475,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	196,972,000	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	226,836,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	227,242,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	113,555,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,012,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,006,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,243,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	152,804,450	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,619,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,602,000	

第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,258,960	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,592,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,842,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	99,934,000	
第465回大阪府公募公債(10年)	160,000,000	156,953,600	
第468回大阪府公募公債(10年)	182,000,000	178,634,820	
第469回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	196,280,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	113,835,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	113,352,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	101,016,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,626,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	96,616,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	99,996,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	138,119,930	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	111,818,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	101,552,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,094,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,942,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,836,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	457,984,000	
平成25年度第7回兵庫県公募公債	100,000,000	100,966,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,221,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	98,530,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	296,967,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	111,671,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	94,411,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	113,493,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	111,790,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,327,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,525,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,625,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,551,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	306,906,200	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	114,220,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,256,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	202,584,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,270,000	
	100,000,000	100,100,000	

平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）			
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	201,204,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	298,209,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,191,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	93,173,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	196,988,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,691,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	179,640,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	113,421,000	
平成21年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	227,306,000	
平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	100,975,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,182,335	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,468,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	385,967,400	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	111,649,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	112,924,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	98,591,000	
第7回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	228,600,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	200,000,000	194,900,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	226,796,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	193,616,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,172,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,553,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,165,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,863,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,500,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	98,459,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	98,306,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	147,132,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,736,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,961,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	105,668,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	114,728,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	106,402,000	
	100,000,000	123,143,000	

平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）			
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	101,108,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,137,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,535,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	93,173,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	99,246,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	296,463,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	98,463,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	96,338,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	225,848,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	113,829,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	113,493,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	101,009,000	
平成25年度第8回千葉県公募公債	300,000,000	302,910,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	101,072,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,136,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	101,575,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,166,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,663,600	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	295,239,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,672,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	296,289,000	
平成30年度第3回茨城県公募公債	350,000,000	350,105,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	224,968,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,454,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,970,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,930,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,955,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,466,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,129,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,543,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,469,440	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,337,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,289,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,237,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,436,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,246,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,174,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,485,402	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,628,000	

第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,225,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,166,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,200,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,038,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,236,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,982,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,553,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,845,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,950,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,605,051	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,507,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	300,489,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,376,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,514,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	227,952,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	89,517,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	291,156,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	100,679,000	
平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,258,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	197,012,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	124,823,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	127,770,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	112,090,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	116,543,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,740,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	296,349,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,108,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	132,055,200	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	226,168,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	114,654,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	113,631,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	89,252,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	89,712,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	106,521,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	339,876,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,529,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,754,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,281,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,684,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	221,434,000	

	令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	296,358,000	
	令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	98,506,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	106,658,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,075,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	112,476,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,474,000	
	第93回川崎市公募公債	100,000,000	98,311,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,119,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,597,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,128,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	113,468,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	112,032,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	202,548,000	
	平成30年度第5回福岡市公募公債（5年）	200,000,000	200,058,000	
	平成30年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	100,023,000	
	平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	151,713,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,146,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,498,750	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,865,300	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	542,729,000	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	199,966,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	196,826,000	
	平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,310,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	201,688,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	111,417,000	
	地方債証券合計	32,361,680,000	33,422,035,675	
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	100,249,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,068,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	81,489,000	
	第21回道路債券	100,000,000	124,698,000	
	第27回道路債券	400,000,000	417,044,000	
	第28回道路債券	200,000,000	252,582,000	
	第33回道路債券	200,000,000	256,014,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,681,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	138,031,000	



第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,293,000	
第42回道路債券	100,000,000	106,094,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,611,000	
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	130,537,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	226,948,000	
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	228,794,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,776,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,800,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,925,000	
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,146,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,161,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,912,000	
第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,023,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,139,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,606,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,246,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,265,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	595,284,000	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,910,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	149,595,440	
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,008,000	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	265,800,000	268,519,134	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,228,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,079,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	533,000,000	539,785,090	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,216,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	223,740,000	

第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	103,343,340	
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	101,373,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,342,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	222,194,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,350,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,251,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,736,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,273,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,866,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,402,000	
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	100,539,000	
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	87,174,000	
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	106,884,440	
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	205,758,500	
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	100,479,000	
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	200,876,000	
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	100,369,000	
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	120,544,800	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,130,000	
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	297,099,000	
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	214,864,560	
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	98,605,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,226,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	364,575,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	106,214,000	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	100,000,000	100,379,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	378,870,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,901,000	

第7回公営企業債券(30年)	200,000,000	253,260,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	41,596,000	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	124,764,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	227,054,000	
第10回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	222,772,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	600,000,000	600,354,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	200,000,000	175,364,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,140,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	228,056,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	113,221,000	
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	500,000,000	565,185,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,013,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,047,900	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	708,134,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,190,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,310,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,684,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,225,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,245,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,094,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,313,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,382,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,075,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,332,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,037,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,249,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,152,090	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,499,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,449,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,397,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,528,000	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,791,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	156,639,600	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,433,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,542,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,530,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,321,000	

F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,426,000	
F 2 0 2 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,052,000	
F 2 0 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,143,000	
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,981,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,106,000	
第 2 9 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,045,000	
第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	105,923,000	
第 1 9 回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,878,000	
第 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	113,662,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	115,701,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,094,500	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,449,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,997,900	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	187,738,650	
第 5 4 回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	220,138,600	
第 8 7 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,952,000	
第 8 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,960,000	
第 8 9 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,013,000	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	207,466,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	151,728,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	83,369,000	
第 1 7 1 回都市再生債券	200,000,000	177,908,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	105,532,000	
第 1 6 回政府保証民間都市開発債券	180,000,000	181,774,800	
第 6 2 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,708,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,126,000	10,184,224	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,546,000	10,663,060	
第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,661,000	10,805,349	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	132,993,000	132,528,854	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	93,106,000	92,837,854	
第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,623,000	10,754,087	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	11,517,000	11,732,828	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	166,146,000	165,298,655	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	11,388,000	11,594,464	
第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	189,186,000	187,922,237	
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	67,498,000	67,211,808	

第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	11,811,000	12,130,841	
第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	226,506,000	225,201,325	
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	10,104,000	10,159,673	
第 9 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	156,258,000	155,518,899	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	11,951,000	12,254,913	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,829,000	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,803,000	16,590,621	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,893,000	16,732,309	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,831,000	18,897,293	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,658,000	20,731,916	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,544,000	22,844,611	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,104,000	23,412,998	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,144,000	48,749,290	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,339,000	10,394,313	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,810,000	21,893,368	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,553,000	10,663,384	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,214,000	10,278,348	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,144,000	22,232,493	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,809,000	21,912,293	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,599,000	20,581,301	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,433,000	11,690,356	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,876,000	43,751,626	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,014,000	23,026,203	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,125,000	11,328,476	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,180,000	30,500,395	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,993,000	29,241,487	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,172,000	29,450,445	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,492,000	65,178,531	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,478,000	78,214,077	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,803,000	40,165,373	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,464,000	41,182,262	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,710,000	41,487,419	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,718,000	36,157,755	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,033,000	35,186,378	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,584,000	41,393,780	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	172,630,500	
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	103,863,000	107,382,917	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	140,784,000	145,534,052	
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,223,000	41,488,817	
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,535,000	42,865,781	

第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,542,000	43,779,121
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,881,000
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	133,695,000	137,514,666
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,032,000	47,158,403
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,796,000	98,477,346
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,000,000	55,102,140
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,772,000	58,766,833
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,115,000	58,384,095
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,258,000	181,864,935
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	119,616,000	122,560,945
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,916,000	59,226,059
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,843,000	64,270,164
第 1 0 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,032,000	68,419,686
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,716,000	74,221,380
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,340,000	73,673,170
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,660,000	74,307,604
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,131,000	75,097,191
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,612,000	75,446,409
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,452,000	77,215,771
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,855,000	77,695,397
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,784,000	77,407,525
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,770,000	77,388,927
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,465,000	78,107,984
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,972,000	157,884,631
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,666,000	78,254,576
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,672,000	160,167,489
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,761,000	79,333,481
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,140,000	158,982,187
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,960,000	80,503,385
第 1 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,812,000	161,595,794
	163,818,000	162,561,515

第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	121,413,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,900,000	82,671,196	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,452,000	82,402,528	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,657,000	81,918,046	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,314,000	168,024,979	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,344,000	84,098,831	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,746,000	83,630,742	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,938,000	169,393,317	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,173,000	85,259,552	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	263,253,000	256,108,313	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,382,000	171,554,424	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,858,000	88,622,452	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,432,000	88,937,159	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,766,000	183,479,220	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,966,000	92,682,424	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,052,000	185,419,272	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,454,000	186,435,997	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,239,000	92,978,082	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,654,000	187,865,562	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,124,000	189,369,481	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,068,000	95,082,342	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,257,000	95,723,257	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	291,513,000	286,869,197	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,536,000	96,102,220	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,080,000	99,034,423	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,924,000	

	第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	94,228,000	
	第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,770,000	
	第64回日本学生支援債券	300,000,000	299,946,000	
	第65回日本学生支援債券	200,000,000	199,958,000	
	第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	106,095,000	
	第24回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	600,798,000	
	い第823号商工債	200,000,000	200,356,000	
	い第829号商工債	200,000,000	200,290,000	
	い第832号商工債	200,000,000	200,004,000	
	い第833号商工債	100,000,000	99,954,000	
	い第843号商工債	200,000,000	200,032,000	
	い第847号商工債	100,000,000	99,911,000	
	い第850号商工債	200,000,000	199,656,000	
	第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,061,000	
	第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,804,000	
	第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,809,000	
	第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,697,000	
	第385回信金中金債（5年）	100,000,000	99,570,000	
	第254号商工債（3年）	300,000,000	299,976,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,446,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	113,910,000	
	第53回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,136,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,684,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,356,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	494,485,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,640,000	
	第60回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,946,000	
	第63回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,942,000	
	第66回西日本高速道路株式会社社債	800,000,000	800,504,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,857,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,997,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	195,182,000	
	特殊債券合計	35,560,506,000	36,538,889,408	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,861,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	298,644,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,722,000	
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	400,000,000	400,856,000	
	第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,691,000	



第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	99,116,000	
第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー円貨社債	100,000,000	99,922,000	
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	100,000,000	99,586,000	
第1回バンコ・サンタンデール・エセ・アー 円貨社債	400,000,000	398,928,000	
第12回ウエストパック・バンキング・コー ポレーション円貨社債	400,000,000	400,160,000	
第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,672,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,809,000	
第15回株式会社長谷工コーポレーション無 担保社債	200,000,000	199,580,000	
第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,107,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,917,000	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,316,000	
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	100,196,000	
第9回明治ホールディングス株式会社無担保 社債	200,000,000	199,684,000	
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	100,215,000	
第13回アサヒグループホールディングス株 式会社無担保社債	200,000,000	199,740,000	
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	101,189,000	
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	198,844,000	
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	299,913,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,080,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,755,000	
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	99,285,000	
第18回東急不動産ホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	99,924,000	
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	99,828,000	
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	199,926,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,879,000	
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	100,072,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	100,107,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,705,000	
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	100,141,000	
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	199,470,000	

第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,152,000	
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	99,599,000	
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	94,441,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,946,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,696,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,001,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	199,026,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	293,526,000	
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	100,089,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	97,285,000	
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,613,000	
第19回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	94,610,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,726,000	
第4回E N E O Sホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,824,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,270,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,943,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,996,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,644,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,954,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,093,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,724,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	106,364,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,724,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,740,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,001,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	98,779,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,194,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,806,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,879,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,893,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,099,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,829,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,592,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,119,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,878,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,034,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,761,000	

第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,262,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,977,000	
第8回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	96,457,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,829,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	92,834,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,252,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,116,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	114,151,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	197,988,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,099,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,775,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	99,158,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	115,738,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	110,301,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	101,043,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,014,000	
第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	303,069,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,893,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,818,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,079,000	
第16回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,032,000	
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,748,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,228,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,875,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,702,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,967,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,875,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,033,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,310,000	
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	99,566,000	
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	99,385,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,674,000	

第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,306,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,132,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,640,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,100,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,687,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,712,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,092,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,016,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,732,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,026,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,817,000	
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	99,764,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	800,000,000	799,824,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,369,000	
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	199,548,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,626,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,782,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,620,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,134,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,332,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,379,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	98,082,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,117,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,762,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,635,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	92,075,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,527,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,640,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,454,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	94,987,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,646,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	96,120,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,977,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,782,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	226,578,000	
	100,000,000	99,587,000	

第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債			
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,473,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,154,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,817,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	90,349,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	93,732,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	86,627,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	112,411,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	90,176,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	97,408,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	500,215,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	93,430,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	123,775,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,555,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,777,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	94,876,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	81,851,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	76,448,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	88,739,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	96,209,000	
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	176,268,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,489,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,051,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,103,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	397,320,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	195,436,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	97,460,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	96,741,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,237,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,571,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,470,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	92,082,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,118,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	200,582,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,794,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,992,000	

第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,227,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,757,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,781,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,591,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,216,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,688,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	197,914,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,308,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,014,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,899,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	197,712,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	127,944,180	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,745,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,611,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,567,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	197,490,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,276,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,314,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	98,590,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,185,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,094,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,326,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,629,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	196,784,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,557,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,025,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,767,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,309,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	96,505,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,412,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,155,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,941,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,205,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,845,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,846,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	300,459,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,877,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	300,231,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,667,000	
	100,000,000	99,352,000	

第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債			
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,366,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	286,506,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	99,776,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	89,682,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	196,740,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	196,262,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	93,225,000	
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	200,600,000	
社債券合計	30,226,000,000	30,063,169,180	
合計		622,122,146,113	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,853,138,629
コール・ローン	401,420,820
株式	513,021,220,277
投資信託受益証券	220,640,102
投資証券	12,397,179,188
派生商品評価勘定	114,167,457
未収入金	4,560,127
未収配当金	825,415,474
前払金	83,495,287
差入委託証拠金	2,354,481,309
流動資産合計	539,275,718,670
資産合計	539,275,718,670
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	197,539,481
未払解約金	247,657,665

	2022年 6月10日現在
項目	金額（円）
未払利息	458
流動負債合計	445,197,604
負債合計	445,197,604
純資産の部	
元本等	
元本	125,392,890,332
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	413,437,630,734
元本等合計	538,830,521,066
純資産合計	538,830,521,066
負債純資産合計	539,275,718,670

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 6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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>



	2022年 6月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 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 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	125,392,890,332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 4.2971円 (1万口当たり純資産額) (42,971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 6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。

	2022年 6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株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2022年 6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)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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月11日
期首元本額	137,902,365,955円
期中追加設定元本額	16,024,952,830円
期中一部解約元本額	28,534,428,453円
期末元本額	125,392,890,332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）	1,888,106,616円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,451,415円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	32,065,774,305円
世界経済インデックスファンド	10,526,520,524円
外国株式インデックス・オープン	878,029,254円
D C マイセレクション 2 5	801,982,711円
D C マイセレクション 5 0	3,633,337,809円
D C マイセレクション 7 5	4,397,181,087円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,808,887,990円
D C マイセレクション S 2 5	403,520,618円
D C マイセレクション S 5 0	1,848,191,942円
D C マイセレクション S 7 5	1,552,706,192円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	45,917,795円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	163,797,526円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	119,813,586円
D C 世界経済インデックスファンド	9,696,175,582円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,489,755,954円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,814,740円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	4,732,946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）	29,906,913円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	15,432,161円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	52,049,376円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	11,345,713円

区分	2022年 6月10日現在
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	31,507,664円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	279,535,720円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	174,708,634円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,277,330,674円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	117,524,348円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	25,080,533円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	163,346,156円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	56,234,075円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,070,221,107円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,121,866,161円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,136,642,109円
コア投資戦略ファンド（安定型）	581,693,447円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,345,785,667円
分散投資コア戦略ファンドA	1,440,748,434円
分散投資コア戦略ファンドS	8,118,588,140円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,293,620,299円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,083,321,241円
コア投資戦略ファンド（切替型）	553,953,401円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	595,619,255円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,413,277円
SMT インデックスバランス・オープン	156,852,050円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	381,514,167円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	15,863,198,047円
SMT 世界経済インデックス・オープン	191,857,768円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	731,615,777円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	135,281,097円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,716,651円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	168,908,015円
グローバル経済コア	643,345,389円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,353,160円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,875,634円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	438,726,468円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	73,340,745円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	38,493,168円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	31,790,211円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	13,559,588円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	15,605,732円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	265,511,505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）	196,360,613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）	1,066,571,822円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,247,140,983円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	206,978,463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）	114,068,581円

区分	2022年 6月10日現在
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	59,191,341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）	75,597,346円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	232,787,423円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	241,405,184円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	240,174,152円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	225,480,922円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	221,972,924円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	151,442,309円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	14,781,726,656
投資信託受益証券	3,482,898
投資証券	691,281,604
合計	15,476,491,158

(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 6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	12,499,447,171	-	12,415,951,884	83,495,287
	買建				
合計		12,499,447,171	-	12,415,951,884	83,495,287

## (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 6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	219,269,560	-	219,146,297	123,263
	アメリカドル	219,269,560	-	219,146,297	123,263
合計		219,269,560	-	219,146,297	123,263

## (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	50.04	1,384,656.84	
	BAKER HUGHES CO	75,948	36.08	2,740,203.84	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	137.35	2,505,676.05	
	CHEVRON CORP	155,015	177.52	27,518,262.80	
	CONOCOPHILLIPS	104,031	118.56	12,333,915.36	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	34.96	2,237,440.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	77.85	3,912,429.60	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	157.83	2,093,930.61	
	EOG RESOURCES INC	46,119	142.49	6,571,496.31	
	EQT CORPORATION	27,026	48.07	1,299,139.82	
	EXXON MOBIL	336,966	102.33	34,481,730.78	
	HALLIBURTON CO	71,583	42.21	3,021,518.43	
	HESS CORP	22,781	126.86	2,889,997.66	
	KINDER MORGAN INC	159,310	19.29	3,073,089.90	
	MARATHON OIL CORP	57,281	31.25	1,790,031.25	
	MARATHON PETROLEUM CORP	45,012	111.36	5,012,536.32	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	74,379	65.18	4,848,023.22	
	ONEOK INC	35,533	66.19	2,351,929.27	
	PHILLIPS 66	38,237	108.27	4,139,919.99	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	276.78	5,044,038.72	

SCHLUMBERGER	112,526	48.14	5,417,001.64
TARGA RESOURCES CORP	17,298	75.08	1,298,733.84
VALERO ENERGY CORP	32,597	143.41	4,674,735.77
WILLIAMS COS	98,553	35.59	3,507,501.27
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	253.62	4,448,748.42
ALBEMARLE CORP	9,440	241.78	2,282,403.20
ALCOA CORP	15,500	55.56	861,180.00
AMCOR PLC	111,485	13.17	1,468,257.45
AVERY DENNISON CORP	6,638	173.95	1,154,680.10
BALL CORP	25,605	70.42	1,803,104.10
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	155.27	1,332,527.14
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	88.89	1,469,085.03
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	20.64	887,520.00
CORTEVA INC	58,500	61.08	3,573,180.00
CROWN HOLDINGS INC	9,940	102.73	1,021,136.20
DOW INC	57,346	65.86	3,776,807.56
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	66.12	2,709,597.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	108.51	1,201,748.25
ECOLAB INC	19,895	164.71	3,276,905.45
FMC CORP	10,507	115.47	1,213,243.29
FREEMPORT-MCMORAN INC	113,194	40.52	4,586,620.88
INT'L PAPER CO	30,800	46.28	1,425,424.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,494	130.80	2,549,815.20
LINDE PLC	40,861	318.69	13,021,992.09
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,803	108.22	2,143,080.66
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,631	332.87	1,541,520.97
MOSAIC CO/THE	27,732	53.66	1,488,099.12
NEWMONT CORPORATION	61,555	64.58	3,975,221.90
NUCOR CORP	22,299	123.66	2,757,494.34
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	156.16	1,200,401.92
PPG INDUSTRIES INC	19,278	123.99	2,390,279.22
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	84.50	883,532.00
SEALED AIR CORP	11,690	61.09	714,142.10
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	261.99	5,166,180.81
STEEL DYNAMICS INC	15,552	76.79	1,194,238.08
VULCAN MATERIALS CO	10,247	161.08	1,650,586.76
WESTLAKE CORP	4,100	130.44	534,804.00
WESTROCK CO	21,356	47.31	1,010,352.36
3 M COMPANY	44,860	144.18	6,467,914.80
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	46.78	514,813.90
ALLEGION PLC	7,601	108.53	824,936.53
AMETEK INC	18,006	118.82	2,139,472.92

BOEING CO	43,246	133.73	5,783,287.58
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	38.85	2,647,938.30
CATERPILLAR	42,499	223.67	9,505,751.33
CUMMINS INC	11,214	211.50	2,371,761.00
DEERE&CO	23,252	345.33	8,029,613.16
DOVER CORP	10,672	132.71	1,416,281.12
EATON CORP	31,624	142.50	4,506,420.00
EMERSON ELECTRIC CO	46,305	89.94	4,164,671.70
FASTENAL CO	44,846	52.84	2,369,662.64
FORTIVE CORP	25,722	61.13	1,572,385.86
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	69.09	712,317.90
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	277.87	1,447,980.57
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	226.89	4,304,103.30
GENERAL ELECTRIC CO	87,527	74.78	6,545,269.06
GRAINGER (WW) INC	3,667	494.42	1,813,038.14
HEICO CORP	3,640	144.06	524,378.40
HEICO CORP-CLASS A	6,449	116.09	748,664.41
HONEYWELL INTL INC	54,596	192.01	10,482,977.96
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	35.17	1,111,160.98
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	214.00	753,708.00
IDEX CORP	5,916	191.15	1,130,843.40
ILLINOIS TOOL WORKS	24,918	203.36	5,067,324.48
INGERSOLL-RAND INC	31,562	48.60	1,533,913.20
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	58.89	1,042,353.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	53.72	3,045,333.08
KORNIT DIGITAL LTD	2,776	39.90	110,762.40
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	240.59	3,773,413.56
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	206.26	521,012.76
LOCKHEED MARTIN CORP	19,332	432.72	8,365,343.04
MASCO CORP	19,462	56.70	1,103,495.40
NORDSON CORP	4,121	214.35	883,336.35
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,737	462.92	5,433,292.04
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	76.00	2,573,208.00
OWENS CORNING	8,642	93.87	811,224.54
PACCAR INC	28,106	88.03	2,474,171.18
PARKER HANNIFIN CORP	9,900	276.96	2,741,904.00
PENTAIR PLC	14,533	49.51	719,528.83
PLUG POWER INC	41,884	16.92	708,677.28
QUANTA SERVICES INC	11,465	130.76	1,499,163.40
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	118,799	97.38	11,568,646.62
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	213.30	1,940,603.40
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,314	406.23	3,377,396.22



SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	47.77	660,563.56
SMITH (A.O.) CORP	9,016	60.81	548,262.96
SNAP-ON INC	4,000	218.67	874,680.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	117.92	1,485,556.16
TEXTRON	16,934	66.82	1,131,529.88
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	134.29	2,502,897.02
TRANSDIGM GROUP INC	4,075	607.90	2,477,192.50
UNITED RENTALS INC	5,393	298.40	1,609,271.20
WABTEC CORP	15,024	92.82	1,394,527.68
XYLEM INC	13,269	82.72	1,097,611.68
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	86.14	978,894.96
CINTAS CORP	7,423	390.92	2,901,799.16
CLARIVATE PLC	27,357	14.45	395,308.65
COPART INC	16,617	112.39	1,867,584.63
COSTAR GROUP INC	32,116	59.69	1,917,004.04
EQUIFAX INC	9,509	191.97	1,825,442.73
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	131.99	1,407,145.39
LEIDOS HOLDINGS	11,220	102.83	1,153,752.60
REPUBLIC SERVICES INC	16,942	128.48	2,176,708.16
ROBERT HALF INTL INC	9,566	87.62	838,172.92
ROLLINS INC	17,468	34.16	596,706.88
TRANSUNION	15,741	82.55	1,299,419.55
VERISK ANALYTICS INC	12,503	166.79	2,085,375.37
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	124.56	2,650,014.00
WASTE MANAGEMENT INC	32,770	153.35	5,025,279.50
AMERCO	734	489.00	358,926.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	102.12	1,049,487.24
CSX CORP	173,146	31.17	5,396,960.82
DELTA AIR LINES INC	14,609	36.75	536,880.75
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	101.20	1,444,326.40
FEDEX CORP	20,314	217.00	4,408,138.00
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	2.89	239,901.79
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	166.06	1,171,055.12
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	46.76	500,332.00
LYFT INC-A	21,288	16.94	360,618.72
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	237.45	4,532,208.15
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	252.27	2,018,916.81
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	42.04	568,927.32
UBER TECHNOLOGIES INC	113,645	25.44	2,891,128.80
UNION PACIFIC CORP	50,721	216.79	10,995,805.59
UNITED PARCEL SERVICE B	58,317	176.55	10,295,866.35
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	52.75	378,481.25

APTIV PLC	20,714	107.22	2,220,955.08
BORGWARNER INC	19,781	39.17	774,821.77
FORD MOTOR COMPANY	305,209	13.28	4,053,175.52
GENERAL MOTORS CO	109,933	36.65	4,029,044.45
LEAR CORP	5,287	140.87	744,779.69
LUCID GROUP INC	31,234	18.88	589,697.92
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	28.87	385,789.81
TESLA INC	69,919	719.12	50,280,151.28
DR HORTON INC	27,764	73.45	2,039,265.80
GARMIN LTD	12,854	101.88	1,309,565.52
HASBRO INC	10,572	87.28	922,777.02
LENNAR CORP-CL A	20,844	78.68	1,640,005.92
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	302.30	2,812,901.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	140.93	586,691.59
NEWELL BRANDS INC	31,461	19.98	628,590.78
NIKE B	101,600	118.60	12,049,760.00
NVR INC	247	4,338.02	1,071,490.94
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	11.12	241,704.32
PULTE GROUP INC	21,609	43.99	950,579.91
VF CORP	25,718	48.43	1,245,522.74
WHIRLPOOL CORP	5,220	170.61	890,584.20
AIRBNB INC-CLASS A	26,610	115.72	3,079,309.20
ARAMARK	20,955	33.76	707,440.80
BOOKING HOLDINGS INC	3,255	2,277.84	7,414,369.20
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	50.16	880,809.60
CARNIVAL CORPORATION	62,102	11.73	728,456.46
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,164	1,369.59	2,963,792.76
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	123.46	1,322,503.52
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	385.44	1,097,733.12
EXPEDIA GROUP INC	11,638	121.99	1,419,719.62
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	135.80	2,971,032.40
LAS VEGAS SANDS CORP	24,370	35.29	860,017.30
MARRIOTT INTL A	22,091	167.65	3,703,556.15
MCDONALD'S CORP	59,191	242.16	14,333,692.56
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	34.32	990,955.68
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	49.37	827,786.79
STARBUCKS CORP	91,531	78.91	7,222,711.21
VAIL RESORTS INC	3,014	245.50	739,937.00
WYNN RESORTS LTD	9,302	66.28	616,536.56
YUM BRANDS INC	22,637	117.32	2,655,772.84
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	76.78	4,732,949.54
ALPHABET INC-CL A	23,937	2,296.71	54,976,347.27

ALPHABET INC-CL C	22,610	2,298.36	51,965,919.60
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	12.78	489,346.20
CABLE ONE INC	445	1,312.97	584,271.65
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	482.26	4,730,488.34
COMCAST CORP-CL A	360,096	42.18	15,188,849.28
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	19.91	400,828.12
ELECTRONIC ARTS INC	21,814	135.81	2,962,559.34
FOX CORP - CLASS A	27,658	33.48	925,989.84
FOX CORP- CLASS B	10,345	30.98	320,488.10
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	85.00	571,285.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	30.25	1,023,478.50
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	120.91	1,362,413.88
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	61.97	953,036.63
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	39.32	534,122.88
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	39.38	251,401.92
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,343	93.92	1,159,254.56
MATCH GROUP INC	22,730	80.42	1,827,946.60
META PLATFORMS INC-CLASS A	183,787	184.00	33,816,808.00
NETFLIX INC	35,348	192.77	6,814,033.96
NEWS CORP-CLASS A	33,479	16.86	564,455.94
OMNICOM GROUP	16,538	69.85	1,155,179.30
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	29.15	1,416,281.90
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	20.25	926,781.75
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	30.50	855,799.50
ROKU INC	9,122	92.37	842,599.14
SEA LTD-ADR	28,338	82.18	2,328,816.84
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.15	371,878.20
SNAP INC - A	83,375	14.10	1,175,587.50
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	129.23	1,662,802.41
THE WALT DISNEY CO	144,924	103.30	14,970,649.20
TWITTER INC	63,066	39.53	2,492,998.98
WARNER BROS DISCOVERY INC	175,398	15.63	2,741,470.74
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	37.34	819,052.90
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	184.66	983,129.84
AMAZON.COM	728,980	116.15	84,671,027.00
AUTOZONE INC	1,639	2,101.15	3,443,784.85
BATH & BODY WORKS INC	19,806	35.35	700,142.10
BEST BUY COMPANY INC	18,175	74.93	1,361,852.75
BURLINGTON STORES INC	5,108	173.91	888,332.28
CARMAX INC	12,051	99.93	1,204,256.43
CARVANA CO	5,700	23.13	131,841.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	29.75	204,620.50

DOLLAR GENERAL CORP	18,686	237.71	4,441,849.06
DOLLAR TREE INC	17,931	159.85	2,866,270.35
DOORDASH INC - A	15,171	68.65	1,041,489.15
EBAY	46,820	46.69	2,186,025.80
ETSY INC	10,294	83.07	855,122.58
GENUINE PARTS CO	11,319	139.59	1,580,019.21
HOME DEPOT	83,117	299.86	24,923,463.62
LKQ CORP	22,779	51.29	1,168,334.91
LOWES COMPANIES	53,337	194.28	10,362,312.36
MERCADOLIBRE INC	3,567	748.40	2,669,560.63
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	619.13	3,347,635.91
POOL CORP	3,304	416.39	1,375,752.56
ROSS STORES INC	28,076	79.76	2,239,341.76
TARGET (DAYTON HUDSON)	38,149	154.55	5,895,927.95
TJX COMPANIES INC	94,981	60.65	5,760,597.65
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	201.65	1,799,121.30
ULTA BEAUTY INC	4,315	422.35	1,822,440.25
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	54.00	324,000.00
COSTCO WHOLESALE CORP	35,297	472.05	16,661,948.85
KROGER CO	56,126	50.43	2,830,434.18
SYSCO CORP	40,288	82.49	3,323,357.12
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	41.72	2,493,479.24
WALMART INC	121,442	121.02	14,696,910.84
ALTRIA GROUP INC	142,972	48.66	6,957,017.52
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,772	85.98	3,849,496.56
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	68.28	1,639,129.68
BUNGE LIMITED	11,604	110.19	1,278,644.76
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	47.00	745,843.00
COCA-COLA CO	327,837	61.80	20,260,326.60
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	53.97	830,814.18
CONAGRA BRANDS INC	35,941	32.25	1,159,097.25
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	241.65	3,126,951.00
GENERAL MILLS INC	46,541	67.93	3,161,530.13
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,352	209.45	2,377,676.40
HORMEL FOODS CORP	23,338	45.30	1,057,211.40
JM SMUCKER CO	9,145	127.25	1,163,701.25
KELLOGG CO	21,630	68.66	1,485,115.80
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	35.71	2,219,555.05
KRAFT HEINZ CO/THE	58,511	37.27	2,180,704.97
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,909	87.36	1,651,890.24
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	52.41	768,802.29
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	110,537	61.23	6,768,180.51

MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	89.30	2,881,443.10
PEPSICO INC	110,121	162.78	17,925,496.38
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	123,371	101.69	12,545,596.99
TYSON FOODS INC	23,306	85.31	1,988,234.86
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	85.98	1,663,369.08
CLOROX COMPANY	9,570	132.09	1,264,101.30
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	76.85	4,902,107.80
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,438	258.79	4,771,570.02
KIMBERLY-CLARK CORP	26,841	127.46	3,421,153.86
PROCTER & GAMBLE CO	190,793	142.49	27,186,094.57
ABBOTT LABORATORIES	140,374	112.71	15,821,553.54
ABIOMED INC	3,781	257.11	972,132.91
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	262.55	1,560,334.65
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	143.96	1,856,508.16
ANTHEM INC	19,210	486.20	9,339,902.00
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	72.03	2,882,136.39
BECTON DICKINSON & CO	22,232	248.37	5,521,761.84
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,802	37.97	4,283,091.94
CARDINAL HEALTH	21,902	52.35	1,146,569.70
CENTENE CORP	46,422	80.02	3,714,688.44
CIGNA CORP	25,554	257.58	6,582,199.32
CVS HEALTH CORP	104,487	92.74	9,690,124.38
DAVITA INC	4,627	93.61	433,133.47
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	39.10	694,963.40
DEXCOM INC	7,647	296.45	2,266,953.15
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49,627	93.64	4,647,072.28
HCA HEALTHCARE INC	19,440	201.26	3,912,494.40
HENRY SCHEIN INC	11,747	82.24	966,073.28
HOLOGIC INC	19,018	73.68	1,401,246.24
HUMANA INC	9,953	449.62	4,475,067.86
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	359.70	2,428,334.70
INSULET CORP	5,311	219.31	1,164,755.41
INTUITIVE SURGICAL INC	28,484	209.95	5,980,215.80
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	229.79	1,745,255.05
MASIMO CORP	4,147	139.42	578,174.74
MCKESSON CORP	12,089	312.03	3,772,130.67
MEDTRONIC PLC	106,878	93.20	9,961,029.60
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	276.99	1,258,919.55
NOVOCURE LTD	7,933	71.50	567,209.50
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	134.89	1,349,574.45
RESMED INC	11,440	208.61	2,386,498.40
STERIS PLC	8,018	221.59	1,776,708.62

STRYKER CORP	27,055	218.97	5,924,233.35
TELADOC HEALTH INC	11,375	33.28	378,560.00
TELEFLEX INC	3,934	271.88	1,069,575.92
THE COOPER COS INC	4,134	337.07	1,393,447.38
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,889	489.43	36,652,923.27
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	117.99	719,974.98
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	187.73	2,112,901.15
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	115.03	1,872,803.43
ABBVIE INC	140,788	145.43	20,474,798.84
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	124.14	2,952,669.90
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	135.00	1,301,805.00
AMGEN	44,045	241.75	10,647,878.75
AVANTOR INC	48,633	31.93	1,552,851.69
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	520.81	965,060.93
BIO-TECHNE CORP	3,245	355.44	1,153,402.80
BIOGEN INC	11,860	202.22	2,398,329.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	76.66	1,133,264.78
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	172,791	75.98	13,128,660.18
CATALENT INC	13,739	109.84	1,509,091.76
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	225.71	948,884.84
DANAHER CORP	54,097	258.76	13,998,139.72
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	23.52	848,154.72
EXACT SCIENCES CORP	14,756	44.59	657,970.04
GILEAD SCIENCES INC	99,836	61.18	6,107,966.48
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	87.05	1,560,458.30
ILLUMINA INC	12,506	224.47	2,807,221.82
INCYTE CORP	15,212	72.78	1,107,129.36
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	216.65	3,277,047.90
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	148.06	736,006.26
JOHNSON & JOHNSON	209,270	173.71	36,352,291.70
LILLY (ELI) & CO	64,434	303.25	19,539,610.50
MERCK & CO	201,204	88.00	17,705,952.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,254.54	2,268,208.32
MODERNA INC	27,309	134.04	3,660,498.36
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	97.30	824,520.20
PERKINELMER INC	9,372	146.45	1,372,529.40
PFIZER	447,595	51.78	23,176,469.10
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,497	575.48	4,889,853.56
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	41.08	1,073,338.24
SEAGEN INC	10,981	141.75	1,556,556.75
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	8.45	679,388.45
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,139	539.82	16,809,454.98

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,030	259.70	5,201,791.00
VIATRIS INC	90,748	11.62	1,054,491.76
WATERS CORP	4,749	336.98	1,600,318.02
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	304.54	1,756,282.18
ZOETIS INC	37,579	166.49	6,256,527.71
BANK OF AMERICA CORP	576,261	34.51	19,886,767.11
CITIGROUP	157,983	49.97	7,894,410.51
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	38.87	1,536,220.14
FIFTH THIRD BANCORP	52,803	37.56	1,983,280.68
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	665.65	632,367.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	147.65	2,035,650.55
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	13.08	1,492,584.96
JPMORGAN CHASE & CO	235,026	125.31	29,451,108.06
KEY CORP	71,472	18.65	1,332,952.80
M & T BANK CORP	14,037	171.36	2,405,380.32
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,936	163.00	5,368,568.00
REGIONS FINL CORP	70,814	21.09	1,493,467.26
SIGNATURE BANK	4,686	214.92	1,007,115.12
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	470.67	2,139,195.15
TRUIST FINANCIAL CORP	105,758	47.71	5,045,714.18
US BANCORP	112,247	50.33	5,649,391.51
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	48.21	688,101.33
WELLS FARGO & CO	303,649	42.67	12,956,702.83
ALLY FINANCIAL INC	27,761	40.46	1,123,210.06
AMERICAN EXPRESS	51,483	160.98	8,287,733.34
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	265.70	2,312,121.40
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	56.66	1,804,847.64
BANK NEW YORK CO	61,254	44.04	2,697,626.16
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	102,772	300.80	30,913,817.60
BLACKROCK INC	12,105	659.85	7,987,484.25
BLACKSTONE INC	55,765	113.85	6,348,845.25
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	119.34	3,968,771.04
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	37.77	591,818.13
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	113.62	1,008,377.50
CME GROUP INC	28,617	197.93	5,664,162.81
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	63.76	610,565.76
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	106.13	2,483,760.39
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,355	28.70	785,088.50
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	369.60	1,163,500.80
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	25.65	668,695.50
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	45.15	194,867.40
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,636	304.22	8,103,203.92

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	99.50	4,447,948.50
INVESCO LTD	26,420	18.06	477,145.20
KKR & CO INC	44,282	53.17	2,354,473.94
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	195.13	1,246,100.18
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	274.01	878,750.07
MOODY'S CORP	13,365	279.44	3,734,715.60
MORGAN STANLEY	106,388	81.16	8,634,450.08
MSCI INC	6,518	427.08	2,783,707.44
NASDAQ INC	9,657	152.75	1,475,106.75
NORTHERN TRUST CORP	15,902	106.35	1,691,177.70
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	121.21	2,170,507.47
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	93.59	1,449,334.74
S&P GLOBAL INC	28,197	336.43	9,486,316.71
SCHWAB (CHARLES) CORP	115,365	64.25	7,412,201.25
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	56.50	539,575.00
STATE STREET CORP	27,998	68.14	1,907,783.72
SYNCHRONY FINANCIAL	41,566	33.85	1,407,009.10
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	68.06	616,691.66
UPSTART HOLDINGS INC	3,148	39.67	124,881.16
AFLAC	50,591	57.43	2,905,441.13
ALLEGHANY CORP	1,080	834.61	901,378.80
ALLSTATE CORP	22,174	127.86	2,835,167.64
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	138.72	876,571.68
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	55.88	3,682,380.24
AON PLC	17,038	259.11	4,414,716.18
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	45.81	1,361,748.06
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	156.96	2,567,708.64
ASSURANT INC	4,726	178.76	844,819.76
BROWN & BROWN INC	19,873	56.84	1,129,581.32
CHUBB LTD	33,670	206.25	6,944,437.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	123.42	1,578,665.22
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	177.43	384,313.38
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	277.93	913,833.84
FNF GROUP	20,461	40.81	835,013.41
GLOBE LIFE INC	8,106	95.43	773,555.58
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	69.78	1,934,371.38
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	54.39	733,394.76
LOEWS CORP	16,741	61.57	1,030,743.37
MARKEL CORP	1,156	1,346.63	1,556,704.28
MARSH & MCLENNAN COS	40,031	153.00	6,124,743.00
METLIFE INC	57,127	66.01	3,770,953.27
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	70.29	1,456,338.51



PROGRESSIVE CORP	46,534	115.54	5,376,538.36
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,511	102.57	3,026,943.27
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	171.53	3,391,491.16
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,385	202.18	1,897,459.30
MR BERKLEY CORP	17,572	69.65	1,223,889.80
CBRE GROUP INC-A	25,382	75.16	1,907,711.12
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.01	494,487.00
WEYERHAEUSER CO	58,295	37.84	2,205,882.80
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	37.15	498,813.05
ACCENTURE PLC-CL A	50,581	295.43	14,943,144.83
ADOBE INC	37,548	426.42	16,011,218.16
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	21.18	271,442.88
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	99.82	1,364,838.86
ANSYS INC	6,794	250.81	1,704,003.14
APPLOVIN CORP-CLASS A	10,000	40.30	403,000.00
AUTODESK INC	17,467	195.06	3,407,113.02
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,443	215.70	7,213,655.10
AVALARA INC	6,847	85.46	585,144.62
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	34.22	478,943.12
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	128.04	953,001.72
BLACK KNIGHT INC	11,543	67.25	776,266.75
BLOCK INC	41,288	76.58	3,161,835.04
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	142.49	1,388,137.58
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,922	155.81	3,415,666.82
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	55.11	587,913.48
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	125.55	1,019,968.20
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	99.05	1,034,478.20
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	51.60	1,046,602.80
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,421	70.77	2,860,594.17
COUPA SOFTWARE INC	6,059	65.40	396,258.60
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,760	173.55	2,735,148.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	139.11	431,241.00
DATADOG INC - CLASS A	17,059	103.64	1,767,994.76
DOCUSIGN INC	14,969	87.36	1,307,691.84
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	22.71	523,874.28
DYNATRACE INC	14,790	42.39	626,948.10
EPAM SYSTEMS INC	4,403	316.60	1,393,989.80
FAIR ISAAC CORP	2,125	404.83	860,263.75
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	48,175	99.74	4,804,974.50
FISERV INC	49,921	95.82	4,783,430.22
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	241.43	1,449,062.86
FORTINET INC	10,645	303.50	3,230,757.50

GARTNER INC	6,340	256.18	1,624,181.20
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	122.09	2,755,205.03
GODADDY INC - CLASS A	13,798	72.57	1,001,320.86
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	77.19	487,686.42
HUBSPOT INC	3,646	353.31	1,288,168.26
INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,112	137.96	9,948,571.52
INTUIT INC	21,247	400.55	8,510,485.85
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	182.52	1,148,233.32
MASTERCARD INC-CLASS A	69,486	349.00	24,250,614.00
MICROSOFT CORP	567,129	264.79	150,170,087.91
MONGODB INC	5,325	290.38	1,546,273.50
NORTONLIFELOCK INC	43,549	24.27	1,056,934.23
OKTA INC	11,505	94.92	1,092,054.60
ORACLE CORP	128,255	69.22	8,877,811.10
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	8.68	1,087,117.92
PALO ALTO NETWORKS INC	7,648	516.15	3,947,515.20
PAYCHEX INC	25,433	122.60	3,118,085.80
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	302.40	1,280,664.00
PAYPAL HOLDINGS INC	88,224	84.11	7,420,520.64
PTC INC	8,304	113.03	938,601.12
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	58.03	370,985.79
SALESFORCE INC	78,410	187.11	14,671,295.10
SERVICENOW INC	15,923	492.22	7,837,619.06
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,606	133.23	2,212,417.38
SPLUNK INC	13,355	102.70	1,371,558.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	62.27	1,203,990.45
SYNOPSYS INC	12,038	317.08	3,817,009.04
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,090	52.51	1,737,555.90
TWILIO INC - A	12,842	98.49	1,264,808.58
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	351.61	1,174,025.79
UNITY SOFTWARE INC	16,329	41.30	674,387.70
VERISIGN INC	7,790	173.61	1,352,421.90
VISA INC-CLASS A SHARES	132,437	206.11	27,296,590.07
VMWARE INC-CLASS A	16,717	127.06	2,124,062.02
WESTERN UNION CO	29,297	17.47	511,818.59
WIX.COM LTD	5,010	60.40	302,604.00
WORKDAY INC-CLASS A	15,615	153.83	2,402,055.45
ZENDESK INC	8,890	69.04	613,765.60
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	110.40	1,879,891.20
ZSCALER INC	6,234	160.42	1,000,058.28
AMPHENOL CORPORATION	47,707	69.14	3,298,461.98
APPLE INC	1,298,829	142.64	185,264,968.56

ARISTA NETWORKS INC	18,880	98.41	1,857,980.80
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	121.81	743,041.00
CDW CORP/DE	10,882	173.59	1,889,006.38
CISCO SYSTEMS	332,253	44.26	14,705,517.78
COGNEX CORP	14,352	45.71	656,029.92
CORNING	64,989	34.26	2,226,523.14
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	50.35	1,131,918.35
F5 INC	4,851	161.99	785,813.49
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	98,742	14.68	1,449,532.56
HP INC	83,910	36.67	3,076,979.70
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	29.58	748,995.18
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	143.86	2,156,317.54
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,961	214.25	2,776,894.25
NETAPP INC	18,303	67.77	1,240,394.31
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	82.85	1,373,901.55
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	127.79	3,331,229.72
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	393.73	1,535,153.27
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	65.04	1,377,287.04
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	56.58	1,459,198.20
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	315.66	1,313,776.92
AT&T INC	568,609	20.88	11,872,555.92
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	23.05	357,643.80
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	24.13	663,261.31
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	11.45	844,655.05
T-MOBILE US INC	49,657	133.02	6,605,374.14
VERIZON COMMUNICATIONS	334,145	50.94	17,021,346.30
AES CORP	54,375	21.55	1,171,781.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	59.63	1,238,992.14
AMEREN CORPORATION	20,898	89.94	1,879,566.12
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,156	98.26	3,945,728.56
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	150.56	2,134,037.44
ATMOS ENERGY CORP	10,802	112.95	1,220,085.90
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	30.61	1,474,238.82
CMS ENERGY CORP	23,697	67.87	1,608,315.39
CONSOLIDATED EDISON INC	27,507	94.51	2,599,686.57
CONSTELLATION ENERGY	25,732	61.21	1,575,055.72
DOMINION ENERGY INC	64,535	79.34	5,120,206.90
DTE ENERGY COMPANY	15,851	128.44	2,035,902.44
DUKE ENERGY CORP	61,255	107.73	6,599,001.15
EDISON INTL	30,339	66.74	2,024,824.86
ENERGY CORP	16,181	116.19	1,880,070.39
ESSENTIAL UTILITIES INC	17,002	45.75	777,841.50

EVERGY INC	18,475	67.37	1,244,660.75	
EVERSOURCE ENERGY	26,753	87.82	2,349,448.46	
EXELON CORP	77,196	46.66	3,601,965.36	
FIRSTENERGY CORP	41,156	40.78	1,678,341.68	
NEXTERA ENERGY INC	156,245	77.34	12,083,988.30	
NISOURCE INC	32,351	30.23	977,970.73	
NRG ENERGY INC	19,068	45.52	867,975.36	
PG&E CORP	118,132	11.63	1,373,875.16	
PPL CORPORATION	58,459	29.14	1,703,495.26	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	65.16	2,571,734.88	
SEMPRA ENERGY	24,535	155.16	3,806,850.60	
SOUTHERN CO	84,113	72.89	6,130,996.57	
UGI CORP	18,019	43.21	778,600.99	
VISTRA CORP	37,797	26.20	990,281.40	
WEC ENERGY GROUP INC	24,561	99.52	2,444,310.72	
XCEL ENERGY INC	43,741	71.28	3,117,858.48	
ADVANCED MICRO DEVICES	130,137	98.80	12,857,535.60	
ANALOG DEVICES	41,625	161.61	6,727,016.25	
APPLIED MATERIALS	70,331	107.24	7,542,296.44	
BROADCOM INC	32,460	556.22	18,054,901.20	
ENPHASE ENERGY INC	10,113	200.51	2,027,757.63	
ENTEGRIS INC	10,491	107.86	1,131,559.26	
INTEL CORP	324,141	40.01	12,968,881.41	
KLA CORP	12,119	349.58	4,236,560.02	
LAM RESEARCH CORP	10,992	493.45	5,424,002.40	
MARVELL TECHNOLOGY INC	67,204	56.48	3,795,681.92	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	66.63	2,950,976.07	
MICRON TECHNOLOGY	89,159	66.02	5,886,277.18	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	444.08	1,568,046.48	
NVIDIA CORP	199,119	180.48	35,936,997.12	
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	184.22	3,840,618.56	
ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	62.66	2,159,764.88	
QORVO INC	8,556	105.13	899,492.28	
QUALCOMM	90,300	136.71	12,344,913.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	103.47	1,383,600.84	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,214	291.67	1,229,097.38	
TERADYNE INC	12,318	101.19	1,246,458.42	
TEXAS INSTRUMENTS	73,796	161.58	11,923,957.68	
	26,127,792		2,781,156,122.11	
			(373,286,774,709)	
アメリカドル 小計				
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	21.47	1,177,844.20
	CAMECO CORP	31,793	33.20	1,055,527.60

CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	84.67	7,890,735.98
CENOVUS ENERGY INC	111,293	30.70	3,416,695.10
ENBRIDGE	161,329	58.65	9,461,945.85
IMPERIAL OIL	16,573	71.36	1,182,649.28
KEYERA CORP	18,607	34.62	644,174.34
PARKLAND CORP	14,075	39.00	548,925.00
PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	52.41	2,393,355.06
SUNCOR ENERGY	116,208	53.05	6,164,834.40
TC ENERGY CORP	77,328	72.71	5,622,518.88
TOURMALINE OIL CORP	25,009	77.33	1,933,945.97
AGNICO EAGLE MINES	36,354	65.19	2,369,917.26
BARRICK GOLD CORP	139,009	25.53	3,548,899.77
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	61.06	802,267.34
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	34.53	1,484,790.00
FRANCO-NEVADA CORP	15,363	179.60	2,759,194.80
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	10.14	525,728.58
KINROSS GOLD CORP	108,451	5.49	595,395.99
LUNDIN MINING CORP	62,243	10.94	680,938.42
NUTRIEN LTD	44,786	113.31	5,074,701.66
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	28.06	516,612.66
TECK RESOURCES LTD-CL B	34,747	55.60	1,931,933.20
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	112.48	686,128.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	51.46	1,761,887.48
CAE INC	25,999	32.67	849,387.33
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	107.51	815,463.35
WSP GLOBAL INC	8,602	146.37	1,259,074.74
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	37.56	507,247.80
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	76.93	788,147.85
THOMSON REUTERS CORP	13,293	126.15	1,676,911.95
AIR CANADA	13,805	20.78	286,867.90
CANADIAN NATL RAILWAY CO	47,367	143.16	6,781,059.72
CP RAILWAY LIMITED	73,737	92.77	6,840,581.49
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	100.56	586,968.72
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	81.97	1,908,425.54
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	85.50	262,485.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	38.99	665,910.21
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	65.31	1,506,897.63
QUEBECOR INC -CL B	15,200	27.34	415,568.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	35.26	1,248,979.72
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	170.68	770,278.84
DOLLARAMA INC	22,000	72.77	1,600,940.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	56.65	3,822,005.55

EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	40.42	616,526.26
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	114.34	1,476,472.42
METRO INC	18,840	69.27	1,305,046.80
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	149.75	782,593.50
SAPUTO INC	20,898	26.26	548,781.48
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	10.64	221,312.00
BANK MONTREAL	51,389	134.63	6,918,501.07
BANK NOVA SCOTIA	96,500	83.32	8,040,380.00
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,829	68.53	4,922,441.37
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	94.79	2,586,724.31
ROYAL BANK OF CANADA	112,726	130.93	14,759,215.18
TORONTO-DOMINION BANK	145,047	93.27	13,528,533.69
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	110,505	62.00	6,851,310.00
IGM FINANCIAL INC	7,685	37.48	288,033.80
ONEX CORP	6,603	74.20	489,942.60
TMX GROUP LTD	4,685	136.03	637,300.55
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	684.93	1,460,955.69
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	33.26	791,188.88
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	65.49	661,383.51
INTACT FINANCIAL CORP	13,312	184.80	2,460,057.60
MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	23.31	3,607,875.18
POWER CORP OF CANADA	43,577	36.31	1,582,280.87
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	62.75	2,867,800.50
FIRSTSERVICE CORP	2,690	160.15	430,803.50
BLACKBERRY LIMITED	39,400	7.35	289,590.00
CGI INC - CL A	16,178	103.88	1,680,570.64
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	1,929.53	3,094,966.12
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	32.01	265,554.96
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	60.86	261,758.86
OPEN TEXT CORP	20,463	50.33	1,029,902.79
SHOPIFY INC - CLASS A	9,256	471.52	4,364,389.12
BCE INC	6,203	67.66	419,694.98
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,167	61.79	1,616,858.93
TELUS CORP	32,908	30.70	1,010,275.60
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.17	941,533.06
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	29.99	731,606.05
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	47.49	536,399.55
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	39.63	409,140.12
EMERA INC	23,223	61.95	1,438,664.85
FORTIS INC	36,823	61.64	2,269,769.72
HYDRO ONE LTD	23,269	34.32	798,592.08
NORTHLAND POWER INC	17,854	39.99	713,981.46

	カナダドル 小計	3,192,748		196,533,457.81 (20,761,794,483)
ユーロ	ENI	197,669	14.02	2,772,505.39
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	12.83	508,863.46
	NESTE OIL OYJ	32,126	45.11	1,449,203.86
	OMV AG	12,549	54.74	686,932.26
	REPSOL SA	111,112	15.71	1,746,125.08
	TENARIS SA	40,648	15.26	620,288.48
	TOTALENERGIES SE	197,385	55.71	10,996,318.35
	AIR LIQUIDE	41,637	141.88	5,907,457.56
	AKZO NOBEL	15,301	77.98	1,193,171.98
	ARCELORMITTAL	48,641	28.50	1,386,268.50
	ARKEMA	4,369	112.55	491,730.95
	BASF SE	73,837	51.87	3,829,925.19
	COVESTRO AG	14,454	43.36	626,725.44
	CRH PLC	59,653	37.58	2,242,058.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	25.62	410,867.94
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	53.90	702,909.90
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	156.30	2,142,404.10
	OCI NV	12,000	31.96	383,520.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	36.08	703,704.32
	SOLVAY SA	5,356	92.56	495,751.36
	STORA ENSO OYJ R	42,169	16.83	709,915.11
	SYMRISE AG	9,776	101.50	992,264.00
	UMICORE	17,605	40.38	710,889.90
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	32.85	1,390,343.40
	VOESTALPINE AG	7,152	27.92	199,683.84
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,143	25.64	542,106.52
	AIRBUS SE	46,955	105.40	4,949,057.00
	ALSTOM	24,388	26.45	645,062.60
	BOUYGUES ORD	16,606	31.58	524,417.48
	BRENTAG SE	12,514	70.68	884,489.52
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	13.63	1,104,384.38
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	29.37	980,772.50
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	160.00	340,800.00
	EIFFAGE	5,924	94.00	556,856.00
	FERROVIAL SA	34,303	25.00	857,575.00
	GEA GROUP AG	13,382	37.41	500,620.62
	IMCD NV	4,641	143.25	664,823.25
	KINGSPAN GROUP PLC	12,398	75.90	941,008.20
	KION GROUP AG	5,887	44.67	262,972.29
	KNORR-BREMSE AG	5,022	64.24	322,613.28

KONE OYJ-B	26,311	48.11	1,265,822.21
LEGRAND SA	21,768	77.78	1,693,115.04
MTU AERO ENGINES AG	3,962	180.70	715,933.40
PRYSMIAN SPA	21,155	29.84	631,265.20
RATIONAL AG	483	614.50	296,803.50
RHEINMETALL AG	3,660	207.90	760,914.00
SAFRAN SA	26,190	95.07	2,489,883.30
SAINT-GOBAIN	40,093	55.36	2,219,548.48
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,053	127.00	5,467,731.00
SIEMENS	61,200	121.68	7,446,816.00
SIEMENS ENERGY AG	36,841	17.22	634,402.02
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	18.02	404,278.70
THALES SA	8,524	113.15	964,490.60
VINCI S.A.	42,507	90.80	3,859,635.60
WARTSILA OYJ	41,917	7.82	328,042.44
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.28	658,918.44
RANDSTAD NV	10,558	52.28	551,972.24
TELEPERFORMANCE	4,734	299.60	1,418,306.40
WOLTERS KLUWER	20,839	86.78	1,808,408.42
ADP	2,382	129.15	307,635.30
AENA SME SA	5,508	138.35	762,031.80
ATLANTIA SPA	35,937	22.57	811,098.09
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.32	286,794.47
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	35.78	2,816,780.49
GETLINK	35,220	17.37	611,771.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	82.66	2,158,004.62
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	75.95	379,066.45
CONTINENTAL AG	8,168	75.36	615,540.48
FERRARI NV	10,170	176.50	1,795,005.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	64,434	66.95	4,313,856.30
MICHELIN	13,839	121.10	1,675,902.90
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	74.96	880,405.20
RENAULT SA	17,362	27.25	473,114.50
STELLANTIS NV	175,794	13.71	2,410,487.32
VALEO SA	16,596	21.39	354,988.44
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,282	157.20	2,245,130.40
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	209.90	521,811.40
ADIDAS AG	13,972	181.40	2,534,520.80
ESSILORLUXOTTICA	22,910	145.75	3,339,132.50
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,074.00	2,726,886.00
KERING	5,855	515.00	3,015,325.00
LVMH	22,101	587.60	12,986,547.60



MONCLER SPA	14,361	43.68	627,288.48
PUMA SE	9,220	70.48	649,825.60
SEB SA	2,282	94.45	215,534.90
ACCOR	14,436	30.01	433,224.36
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	105.90	1,381,783.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	33.90	274,861.20
SODEXO	6,027	69.66	419,840.82
BOLLORE SE	83,646	4.75	397,318.50
PUBLICIS GROUPE	17,077	49.21	840,359.17
SCOUT24 SE	7,492	57.60	431,539.20
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	46.63	329,720.73
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	21.06	1,290,083.79
VIVENDI SE	61,243	11.04	676,122.72
D' IETEREN GROUP	2,217	155.10	343,856.70
DELIVERY HERO SE	13,414	38.79	520,329.06
INDITEX	87,326	23.75	2,073,992.50
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	20.41	317,902.38
PROSUS	66,706	50.97	3,400,004.82
ZALANDO SE	17,664	31.59	558,005.76
CARREFOUR	52,544	18.64	979,682.88
HELLOFRESH SE	13,805	33.68	464,952.40
JERONIMO MARTINS	24,901	18.54	461,664.54
KESKO OYJ-B SHS	20,083	22.85	458,896.55
KONINKLIJKE AHOLD NV	79,170	25.35	2,007,355.35
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,711	50.81	3,491,205.91
DANONE (GROUPE)	51,543	53.34	2,749,303.62
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	9.77	479,776.75
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	72.20	667,922.20
HEINEKEN NV	20,157	91.54	1,845,171.78
JDE PEET'S BV	7,000	26.88	188,160.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	92.60	1,208,430.00
PERNOD-RICARD	16,694	176.85	2,952,333.90
REMY COINTREAU	1,382	169.30	233,972.60
BEIERSDORF AG	7,430	98.72	733,489.60
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	61.05	536,019.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	61.36	885,977.04
LOREAL	19,188	322.35	6,185,251.80
AMPLIFON SPA	11,650	30.75	358,237.50
BIOMERIEUX	3,044	91.52	278,586.88
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	123.40	423,262.00
DIASORIN SPA	2,070	119.15	246,640.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	51.28	870,990.80

FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	30.41	1,024,482.49
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	22.96	1,647,494.80
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	368.20	671,596.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	54.78	1,181,440.26
ARGENX SE	3,976	309.70	1,231,367.20
BAYER	78,757	65.39	5,149,920.23
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	84.44	862,976.80
GRIFOLS SA	27,685	18.63	515,771.55
IPSEN	3,532	90.65	320,175.80
MERCK KGAA	10,555	173.05	1,826,542.75
ORION OYJ-CLASS B	9,854	36.65	361,149.10
QIAGEN N.V.	17,038	43.46	740,471.48
RECORDATI SPA	9,859	38.74	381,937.66
SANOFI	90,542	98.26	8,896,656.92
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,939	320.20	620,867.80
UCB (GROUPE)	9,389	83.10	780,225.90
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.77	430,148.77
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	4.74	2,537,136.87
BANCO SANTANDER SA	1,393,640	2.90	4,049,917.84
BNP PARIBAS	86,730	51.19	4,439,708.70
CAIXABANK	330,447	3.46	1,145,659.74
COMMERZBANK AG	81,889	8.19	670,670.91
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	9.80	975,534.47
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	29.15	696,830.75
FINECOBANK SPA	53,120	12.04	639,564.80
ING GROEP NV-CVA	301,618	10.21	3,079,519.78
INTESA SANPAOLO	1,322,943	1.96	2,601,964.29
KBC GROEP NV	18,608	57.54	1,070,704.32
MEDIOBANCA	53,990	9.65	521,111.48
SOCIETE GENERALE	63,329	24.88	1,575,625.52
UNICREDIT SPA	168,352	10.56	1,779,143.93
AMUNDI SA	4,626	51.95	240,320.70
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	10.01	1,608,378.58
DEUTSCHE BOERSE	14,999	150.55	2,258,099.45
EURAZEO SA	3,357	70.55	236,836.35
EURONEXT NV	6,480	75.44	488,851.20
EXOR NV	7,825	66.14	517,545.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	84.94	723,264.10
SOFINA	1,238	210.60	260,722.80
WENDEL	2,023	93.45	189,049.35
AEGON	148,741	4.87	724,963.63
AGEAS	11,086	43.21	479,026.06

ALLIANZ SE-REG	32,696	189.38	6,191,968.48
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	16.48	1,411,725.94
AXA SA	154,335	23.41	3,612,982.35
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	142.55	617,669.15
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,795	225.20	2,431,034.00
NN GROUP NV	22,611	46.32	1,047,341.52
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.73	448,104.69
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	42.09	1,626,988.95
AROUNDTOWN SA	64,068	4.05	259,795.74
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	88.04	464,411.00
VONOVIA SE	59,080	33.88	2,001,630.40
ADYEN NV	1,746	1,417.60	2,475,129.60
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	55.76	1,984,163.84
BECHTLE AG	7,659	41.21	315,627.39
CAPGEMINI SA	12,715	176.45	2,243,561.75
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	37.73	1,991,162.74
EDENRED	18,664	44.23	825,508.72
NEMETSCHKE SE	5,455	65.12	355,229.60
NEXI SPA	48,458	8.76	424,879.74
SAP SE	83,516	92.35	7,712,702.60
WORLDLINE SA	20,332	38.95	791,931.40
NOKIA OYJ	427,600	4.63	1,982,567.40
CELLNEX TELECOM SA	41,435	41.18	1,706,293.30
DEUTSCHE TELEKOM	258,113	18.56	4,790,577.28
ELISA A	10,227	53.06	542,644.62
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.19	309,521.25
KPN (KON.)	282,927	3.31	937,054.22
ORANGE	153,815	10.85	1,669,200.38
PROXIMUS	13,141	15.32	201,320.12
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.27	232,064.65
TELEFONICA	417,939	4.55	1,904,965.96
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.72	268,899.66
TELEFONICA SA-RTS	417,939	0.14	61,228.06
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	28.86	274,545.18
ACCIONA SA	2,181	188.00	410,028.00
E.ON SE	170,377	9.57	1,631,189.39
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	23.19	497,796.54
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	8.61	340,591.97
ELIA GROUP SA/NV	2,925	147.90	432,607.50
ENAGAS	21,663	22.00	476,586.00
ENDESA	25,972	20.76	539,178.72
ENEL	650,125	5.72	3,724,566.12

	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.71	1,063,748.13
	ENGIE	141,564	12.46	1,763,887.44
	FORTUM OYJ	32,550	17.04	554,814.75
	IBERDROLA SA	464,738	10.59	4,921,575.42
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	28.13	281,581.30
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	18.86	578,740.47
	RWE STAMM	49,680	41.05	2,039,364.00
	SNAM SPA	147,559	5.29	781,177.34
	TERNA SPA	102,810	7.66	787,935.84
	UNIPER SE	7,335	22.28	163,423.80
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	26.46	1,350,174.42
	VERBUND AG	6,430	95.75	615,672.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,483	281.90	981,857.70
	ASML HOLDING NV	32,248	520.70	16,791,533.60
	INFINEON TECHNOLOGIES	101,861	27.53	2,804,233.33
	STMICROELECTRONICS	55,076	35.98	1,981,634.48
	ユーロ 小計	15,093,950		342,686,095.82 (48,846,476,098)
イギリスポンド	BP PLC	1,555,608	4.48	6,973,790.66
	SHELL PLC-NEW	605,870	23.95	14,513,615.85
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	39.04	3,988,681.02
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	14.84	532,103.04
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	64.74	707,219.76
	GLENCORE PLC	767,331	5.33	4,091,408.89
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	20.45	344,541.60
	MONDI PLC	36,710	15.16	556,707.15
	RIO TINTO PLC REG	89,551	59.00	5,283,509.00
	ASHTREAD GROUP PLC	34,104	40.49	1,380,870.96
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	7.77	2,022,048.49
	BUNZL PLC	24,880	26.57	661,061.60
	DCC PLC	6,622	55.68	368,712.96
	FERGUSON PLC	17,761	93.10	1,653,549.10
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.64	525,393.61
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.91	583,064.96
	SMITHS GROUP PLC	26,476	15.43	408,524.68
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	102.00	562,428.00
	EXPERIAN PLC	74,115	24.87	1,843,240.05
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	44.48	617,827.20
	RELX PLC	154,242	21.81	3,364,018.02
	RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	4.91	690,178.24
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	5.03	368,645.27
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	42.06	323,357.28

BURBERRY GROUP PLC	29,776	16.84	501,576.72
PERSIMMON PLC	25,686	21.93	563,293.98
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.28	340,298.00
COMPASS GROUP PLC	142,427	17.76	2,530,215.65
ENTAIN PLC	49,630	14.50	719,635.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	49.23	729,145.53
WHITBREAD PLC	17,434	27.46	478,737.64
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.58	404,627.80
INFORMA PLC	110,598	5.52	610,500.96
PEARSON	55,305	7.35	406,823.58
WPP PLC	95,821	8.71	835,367.47
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.21	251,292.37
KINGFISHER PLC	153,717	2.46	379,219.83
NEXT PLC	11,468	63.72	730,740.96
OCADO GROUP PLC	35,862	9.15	328,280.74
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.09	310,613.49
TESCO PLC	601,050	2.52	1,515,848.10
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	16.52	425,224.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	173,494	34.96	6,065,350.24
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	17.75	318,790.00
DIAGEO	184,500	35.98	6,639,232.50
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	17.95	1,365,636.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,022	60.68	3,460,094.96
UNILEVER PLC	201,915	36.38	7,345,667.70
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	12.32	845,090.40
ASTRAZENECA	123,390	100.56	12,408,098.40
GSK PLC	405,046	17.09	6,925,476.50
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	16.11	265,073.94
BARCLAYS	1,339,545	1.65	2,222,573.06
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,613,344	5.11	8,257,094.59
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,667,831	0.44	2,538,621.50
NATWEST GROUP PLC	443,701	2.28	1,012,969.38
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.96	1,267,877.72
3I GROUP PLC	74,757	11.66	872,040.40
ABRDN PLC	153,430	1.83	281,007.04
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.11	268,403.00
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	71.10	1,869,716.70
M&G PLC	229,107	2.13	489,830.76
SCHRODERS PLC	11,794	27.80	327,873.20
ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	11.90	487,319.27
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	22.00	357,610.00
AVIVA PLC	225,378	4.22	952,898.18

	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.53	1,168,484.82
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.30	321,714.30
	PRUDENTIAL	210,968	10.30	2,174,025.24
	AVEVA GROUP PLC	10,917	23.78	259,606.26
	SAGE GROUP PLC	76,660	6.40	490,624.00
	HALMA PLC	31,069	21.62	671,711.78
	BT GROUP PLC	557,358	1.81	1,010,211.37
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.26	2,777,979.96
	NATIONAL GRID PLC	286,046	10.84	3,102,168.87
	SEVERN TRENT PLC	22,468	29.02	652,021.36
	SSE PLC	81,663	17.64	1,440,943.63
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.43	610,989.40
	イギリスポンド 小計	22,541,258		145,950,766.44 (24,477,403,039)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.29	335,607.42
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	779.00	447,146.00
	GIVAUDAN-REG	748	3,400.00	2,543,200.00
	HOLCIM LTD	44,847	48.80	2,188,533.60
	SIKA AG-BR	11,714	256.00	2,998,784.00
	ABB LTD	127,656	29.63	3,782,447.28
	GEBERIT AG-REG	2,964	516.60	1,531,202.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	183.80	376,422.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	186.65	577,121.80
	VAT GROUP AG	1,956	265.60	519,513.60
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	36.85	385,082.50
	SGS SA	506	2,255.00	1,141,030.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	227.00	1,038,979.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,341	107.85	4,458,626.85
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	244.80	607,838.40
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	46.54	183,274.52
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,122.00	594,160.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	97,600.00	780,800.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,520.00	780,640.00
	NESTLE SA - REGISTERED	224,341	110.54	24,798,654.14
	ALCON INC	39,333	72.06	2,834,335.98
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,007	333.60	1,336,735.20
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	115.45	985,943.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	74.45	137,732.50
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	557.00	3,283,515.00
	NOVARTIS	174,768	85.33	14,912,953.44
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	362.40	802,716.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	56,019	318.05	17,816,842.95

	VIFOR PHARMA AG/NEW	3,360	170.30	572,208.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	6.57	1,402,516.88	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	49.24	930,488.28	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	987.20	1,809,537.60	
	UBS GROUP AG	281,888	17.22	4,855,520.80	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	158.70	503,713.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	540.00	1,306,260.00	
	SWISS RE LTD	24,445	78.88	1,928,221.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,053	432.80	5,216,538.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	91.40	519,060.60	
	TEMENOS AG - REG	5,150	84.92	437,338.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	57.16	839,451.76	
	SWISSCOM	2,187	553.80	1,211,160.60	
	スイスフラン 小計	1,382,744		113,711,854.30 (15,578,524,039)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	482.30	8,306,170.60	
	BOLIDEN AB	22,252	403.50	8,978,682.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	10,000	473.40	4,734,000.00	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	170.60	7,487,122.20	
	ALFA LAVAL AB	27,268	257.50	7,021,510.00	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	239.70	18,734,472.60	
	ATLAS COPCO A	205,280	109.26	22,428,892.80	
	ATLAS COPCO B	127,608	95.60	12,199,324.80	
	EPIROC AB-A	53,479	189.30	10,123,574.70	
	EPIROC AB-B	28,804	164.60	4,741,138.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	85.80	3,321,489.60	
	INDUTRADE AB	22,644	224.40	5,081,313.60	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	228.90	3,205,057.80	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	185.95	3,341,521.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	84.66	10,400,311.68	
	SANDVIK AB	87,644	201.10	17,625,208.40	
	SKANSKA B	25,507	167.45	4,271,147.15	
	SKF AB-B	24,865	173.30	4,309,104.50	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	183.90	2,485,224.60	
	VOLVO B	121,238	175.54	21,282,118.52	
	SECURITAS B	29,533	97.86	2,890,099.38	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	85.00	4,236,315.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	144.06	3,064,012.14	
	EVOLUTION AB	14,096	1,015.40	14,313,078.40	
EMBRACER GROUP AB	53,147	91.80	4,878,894.60		
HENNES & MAURITZ B	55,229	139.78	7,719,909.62		
SWEDISH MATCH AB	127,270	101.00	12,854,270.00		

	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	255.00	12,615,870.00	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	275.80	4,908,136.80	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	206.50	2,960,177.50	
	NORDEA BANK ABP	253,851	98.72	25,060,170.72	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	111.90	14,686,315.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	97.84	10,834,410.24	
	SWEDBANK AB-A	72,526	155.55	11,281,419.30	
	EQT AB	23,207	255.70	5,934,029.90	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	253.00	2,989,954.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	249.70	2,788,649.60	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	199.10	7,749,967.50	
	INVESTOR AB-B SHS	142,777	179.80	25,671,304.60	
	KINNEVIK AB - B	18,792	181.65	3,413,566.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	448.90	3,267,992.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	61.64	3,494,988.00	
	SAGAX AB-B	12,402	241.70	2,997,563.40	
	SINCH AB	44,150	40.51	1,788,737.25	
	ERICSSON (LM) B	225,508	81.32	18,338,310.56	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	116.70	17,952,894.60	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	119.95	5,609,101.90	
	TELIA CO AB	230,643	39.50	9,110,398.50	
	スウェーデンクローナ 小計	3,127,218		423,487,923.26 (5,729,791,601)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	11,378	413.20	4,701,389.60	
	EQUINOR ASA	76,370	356.25	27,206,812.50	
	NORSK HYDRO	96,800	71.58	6,928,944.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	479.60	5,994,040.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	337.80	2,920,281.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	75.35	1,440,465.95	
	MOWI ASA	31,968	237.10	7,579,612.80	
	ORKLA	69,804	72.26	5,044,037.04	
	SALMAR ASA	5,423	681.00	3,693,063.00	
	DNB BANK ASA	71,795	188.85	13,558,485.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	199.50	3,705,513.00	
	TELENOR ASA	51,193	128.25	6,565,502.25	
	ノルウェークローネ 小計	473,565		89,338,147.69 (1,248,947,304)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	496.10	4,208,416.30	
	NOVOZYMES A/S	17,111	424.60	7,265,330.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,887.00	1,424,685.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	81,654	179.76	14,678,123.04	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	18,940.00	4,147,860.00	



	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	19,150.00	8,311,100.00	
	DSV A/S	15,307	1,038.00	15,888,666.00	
	PANDORA A/S	8,163	530.00	4,326,390.00	
	CARLSBERG AS-B	7,077	864.80	6,120,189.60	
	COLOPLAST-B	9,208	806.00	7,421,648.00	
	DEMANT A/S	8,512	300.40	2,557,004.80	
	GN STORE NORD A/S	9,226	263.50	2,431,051.00	
	GENMAB A/S	5,250	2,103.00	11,040,750.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	134,058	794.00	106,442,052.00	
	DANSKE BANK A/S	56,132	116.15	6,519,731.80	
	TRYG A/S	29,772	158.95	4,732,259.40	
	ORSTED A/S	15,439	757.30	11,691,954.70	
	デンマーククローネ 小計	406,800		219,207,212.24 (4,200,010,186)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	36.15	745,738.35	
	SANTOS	265,406	8.66	2,298,415.96	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	25.19	322,759.47	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	146,194	35.39	5,173,805.66	
	BHP GROUP LTD	405,288	46.24	18,740,517.12	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	18.11	629,684.70	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	3.58	437,311.32	
	FORTECUE METALS GROUP LTD	138,592	21.56	2,988,043.52	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	34.30	1,267,316.40	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	57.92	834,569.28	
	NEWCREST MINING LIMITED	73,939	23.76	1,756,790.64	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	8.48	861,805.44	
	ORICA LTD	38,288	16.23	621,414.24	
	RIO TINTO LTD	28,818	117.47	3,385,250.46	
	SOUTH32 LTD	341,133	5.01	1,709,076.33	
	REECE LTD	16,814	14.08	236,741.12	
	BRAMBLES LTD	108,007	10.82	1,168,635.74	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	4.18	499,890.38	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.21	442,850.00	
	TRANSURBAN GROUP	249,674	14.20	3,545,370.80	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	34.65	1,601,176.50	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	13.00	394,264.00	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	63.70	225,561.70	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	23.42	416,712.06	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.57	831,799.41	
	REA GROUP LTD	3,586	105.00	376,530.00	
	SEEK LTD	28,001	22.33	625,262.33	
	WESFARMERS LTD	91,917	44.79	4,116,962.43	

	COLES GROUP LTD	108,486	17.61	1,910,438.46	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.13	783,594.13	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	34.51	3,447,583.51	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.07	708,037.20	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	216.30	1,034,562.90	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	77.47	1,258,732.56	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	34.18	1,273,239.18	
	CSL LIMITED	38,619	271.69	10,492,396.11	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	225,511	23.35	5,265,681.85	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	136,527	94.95	12,963,238.65	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	253,530	28.25	7,162,222.50	
	WESTPAC BANKING	283,793	21.17	6,007,897.81	
	ASX LTD	14,549	79.12	1,151,116.88	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,434	178.68	5,259,267.12	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	168,725	4.29	723,830.25	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.18	738,341.94	
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.23	1,364,757.93	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	10.94	1,037,812.16	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	23.51	1,043,279.76	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	39.60	546,519.60	
	XERO LTD	11,340	79.72	904,024.80	
	TELSTRA CORP	308,467	3.86	1,190,682.62	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	6.21	940,610.07	
	オーストラリアドル 小計	5,322,791		123,462,123.35 (11,752,359,521)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.80	919,393.80	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	20.26	809,994.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.81	832,697.58	
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.78	373,463.14	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.71	520,662.24	
	ニュージーランドドル 小計	506,126		3,456,211.56 (296,473,827)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	53.45	11,438,086.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	100.40	10,742,800.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	18.20	3,130,400.00	
	MTR CORP	125,000	41.85	5,231,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	27.60	3,312,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	44.00	7,656,000.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	16.08	3,183,840.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	13.74	2,366,028.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	21.55	3,144,145.00	
	WH GROUP LTD	658,301	5.76	3,791,813.76	

	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	29.65	8,346,475.00	
	HANG SENG BANK	59,400	135.70	8,060,580.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	355.40	34,047,320.00	
	AIA GROUP LTD	962,400	82.40	79,301,760.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	52.40	8,619,590.40	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	22.80	3,579,600.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	15.12	2,615,760.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	30.35	3,800,669.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	30.20	4,118,525.00	
	SINO LAND CO	315,400	11.22	3,538,788.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	96.30	10,400,400.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	48.95	1,982,475.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	19.62	1,887,444.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	36.60	4,355,400.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	50.70	3,422,250.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	75.80	10,422,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	8.54	7,725,770.78	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	50.30	5,633,600.00	
	香港ドル 小計	6,142,353		255,855,270.94 (4,375,125,133)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.92	780,576.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.14	610,236.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.36	580,659.52	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.77	476,625.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.17	744,762.00	
	DBS GROUP	141,500	30.36	4,295,940.00	
	OCBC BANK	257,100	11.76	3,023,496.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	28.05	2,633,895.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.72	641,520.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.86	862,710.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.30	355,240.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.35	349,125.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	17.54	450,778.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.54	1,484,739.22	
	シンガポールドル 小計	2,644,675		17,290,301.74 (1,679,752,814)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	34.45	2,047,260.15	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	692.40	1,485,890.40	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	31.64	3,110,528.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	32.96	3,588,157.44	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.56	1,946,220.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	116.00	1,450,348.00	

	AZRIELI GROUP	4,323	241.40	1,043,572.20	
	NICE LTD	4,991	693.10	3,459,262.10	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	160.90	1,609,000.00	
	イスラエルシケル 小計	400,064		19,740,238.69 (787,787,523)	
	合 計	87,362,084		513,021,220,277 (513,021,220,277)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	82,693	960,065.73	
		LENDLEASE GROUP	64,786	660,817.20	
	オーストラリアドル 小計		147,479	1,620,882.93 (154,291,846)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,682,415.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	205,000	2,197,600.00	
	香港ドル 小計		425,500	3,880,015.00 (66,348,256)	
投資信託受益証券合計			572,979	220,640,102 (220,640,102)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,110	1,822,191.70	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	906,556.20	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,293	9,443,438.60	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	124,611	828,663.15	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,208,266.84	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	1,109,799.63	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,045,417.59	
		CROWN CASTLE INTL CORP	34,413	6,181,607.19	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,174	2,954,020.28	
		DUKE REALTY CORP	30,517	1,580,170.26	
		EQUINIX INC	7,120	4,687,950.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,004,335.20	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	27,140	1,960,050.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,410,034.50	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,840,278.44	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,175,079.40	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,130,350.43	
		INVITATION HOMES INC	46,840	1,717,154.40	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,219,716.54	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	1,021,643.01	

	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	807,080.68
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,553,311.35
	PROLOGIS INC	58,917	7,197,889.89
	PUBLIC STORAGE	12,441	3,853,724.16
	REALTY INCOME CORP	47,102	3,121,920.56
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	782,187.72
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,863,717.95
	SIMON PROPERTY GROUP	25,518	2,650,554.66
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,432,451.30
	UDR INC	24,265	1,097,020.65
	VENTAS INC	31,565	1,683,045.80
	VICI PROPERTIES INC	75,321	2,310,848.28
	VORNADO REALTY TRUST	11,390	358,785.00
	WELLTOWER INC	35,629	2,965,401.67
	WP CAREY INC	14,258	1,165,021.18
	アメリカドル 小計	1,025,752	79,089,685.41 (10,615,417,575)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	232,425.72
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	337,682.00
	カナダドル 小計	20,377	570,107.72 (60,226,179)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	313,350.30
	GECINA SA	3,139	331,478.40
	KLEPIERRE	17,225	357,935.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	643,818.90
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	424,095.76
	ユーロ 小計	48,695	2,070,678.86 (295,154,564)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	412,317.48
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	348,371.01
	SEGRO PLC	93,383	969,782.45
	イギリスポンド 小計	219,086	1,730,470.94 (290,217,281)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	930,550.10
	GOODMAN GROUP	133,807	2,557,051.77
	GPT GROUP	167,884	758,835.68
	MIRVAC GROUP	266,683	557,367.47
	SCENTRE GROUP	382,183	1,043,359.59
	STOCKLAND	207,412	771,572.64
	VICINITY CENTERS	365,149	673,699.90
	オーストラリアドル 小計	1,617,208	7,292,437.15 (694,167,092)
香港ドル	LINK REIT	170,500	11,892,375.00

	香港ドル 小計	170,500	11,892,375.00 (203,359,612)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	809,793.30	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	762,560.96	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	402,600.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	481,421.30	
	シンガポールドル 小計	1,127,756	2,456,375.56 (238,636,885)	
	投資証券合計	4,229,374	12,397,179,188 (12,397,179,188)	
	合計		12,617,819,290 (12,617,819,290)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 604銘柄	97.2%			71.0%
	投資証券 35銘柄			2.8%	2.0%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%			3.9%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 224銘柄	99.4%			9.3%
	投資証券 5銘柄			0.6%	0.1%
イギリスポンド	株式 78銘柄	98.8%			4.7%
	投資証券 3銘柄			1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%			3.0%
スウェーデンクローナ	株式 48銘柄	100.0%			1.1%
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 51銘柄	93.3%			2.2%
	投資信託受 益証券 2銘柄		1.2%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.5%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 28銘柄	94.2%			0.8%

	投資信託受 2銘柄 益証券		1.4%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.4%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	87.6%			0.3%
	投資証券 4銘柄			12.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 6月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	248,360,064
コール・ローン	3,269,605,957
国債証券	309,477,572,304
派生商品評価勘定	118,522,745
未収入金	45,713,423
未収利息	1,564,144,710
前払金	42,052,033
前払費用	80,740,747
差入委託証拠金	642,404,495
流動資産合計	315,489,116,478
資産合計	315,489,116,478
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	42,124,702
未払金	11,054,091
未払解約金	572,278,377
未払利息	3,732
流動負債合計	625,460,902
負債合計	625,460,902
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	99,895,494,586
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	214,968,160,990
元本等合計	314,863,655,576
純資産合計	314,863,655,576
負債純資産合計	315,489,116,478

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 6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>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)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>(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 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	99,895,494,586口



	2022年 6月10日現在	
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)	3.1519円 (31,519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 6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債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 6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

	2022年 6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>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月11日
期首元本額	99,315,132,569円
期中追加設定元本額	17,946,613,272円
期中一部解約元本額	17,366,251,255円
期末元本額	99,895,494,586円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,319,963,872円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	568,968,621円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	387,700,518円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,173,864,177円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,669,457円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,230,273,450円
世界経済インデックスファンド	13,838,312,799円
DCマイセレクション25	1,949,811,414円
DCマイセレクション50	1,680,963,726円

区分	2022年 6月10日現在
D Cマイセレクション7 5	1,142,023,279円
D C外国債券インデックス・オープン	2,296,168,954円
D CマイセレクションS 2 5	952,616,534円
D CマイセレクションS 5 0	750,753,709円
D CマイセレクションS 7 5	423,340,282円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	30,384,057円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	92,295,990円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	47,369,299円
D C世界経済インデックスファンド	12,733,710,481円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	591,190,221円
マイセレクション5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	1,650,011円
マイセレクション7 5 V A 1(適格機関投資家専用)	1,324,475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)	23,151,839円
バランス3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	47,930,499円
バランス5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	71,067,611円
バランス2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	74,317,281円
バランス5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	68,793,252円
バランスA(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	1,299,182,324円
バランスB(3 7. 5)V A 1(適格機関投資家専用)	444,034,382円
バランスC(5 0)V A 1(適格機関投資家専用)	1,751,677,877円
世界バランスV A 1(適格機関投資家専用)	81,370,014円
世界バランスV A 2(適格機関投資家専用)	40,309,570円
バランスD(3 5)V A 1(適格機関投資家専用)	445,565,095円
バランスE(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	169,123,558円
バランスF(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	210,882,678円
F O F s用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	737,006,178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)	2,526,680,657円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	744,139,958円
外国債券ファンド・シリーズ1	701,214,337円
コア投資戦略ファンド(安定型)	539,035,373円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,411,756,777円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	548,803,564円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,005,436,256円
コア投資戦略ファンド(切替型)	569,671,531円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	250,703,262円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	111,883,133円
S M T グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,324,419,977円
S M T インデックスバランス・オープン	197,038,113円
外国債券S M T Bセレクション(SMA専用)	15,716,081,124円
S M T 世界経済インデックス・オープン	253,542,314円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	315,349,814円

区分	2022年 6月10日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	504,887,461円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,179,541円
グローバル経済コア	844,055,727円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	16,652,672円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	1,802,319円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	185,614,783円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	29,022,986円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	14,464,840円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	14,795,968円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	7,084,831円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	8,866,292円
M y S M T グローバル債券インデックス(ノーロード)	159,703円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	283,040,045円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	11,070,181,757円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	331,708,667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)	305,299,544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)	345,682,511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)	1,040,592,444円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	79,378,748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)	88,982,234円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年 6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	8,155,796,655
合計	8,155,796,655

(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 6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	3,077,131,592	-	3,035,079,559	42,052,033
	合計	3,077,131,592	-	3,035,079,559	42,052,033

## (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 6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	2,789,604,324	-	2,907,756,102	118,151,778
	アメリカドル	1,519,357,468	-	1,588,821,440	69,463,972
	カナダドル	124,711,337	-	130,963,592	6,252,255
	ユーロ	968,578,108	-	1,003,527,360	34,949,252
	イギリスポンド	176,957,411	-	184,443,710	7,486,299
	売建	65,831,432	-	65,533,134	298,298
	イギリスポンド	65,831,432	-	65,533,134	298,298
合計		2,855,435,756	-	2,973,289,236	118,450,076

## (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	9,601,171.90	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,511,020.91	
		T 0.125% 05/31/23	6,800,000.00	6,653,109.39	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,868,945.30	

T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,818,514.82	
T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,740,781.28	
T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,128,823.23	
T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,445,722.64	
T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,524,023.40	
T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	7,829,531.28	
T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,548,945.29	
T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	919,765.63	
T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,769,578.11	
T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,643,281.28	
T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,845,507.85	
T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,277,265.61	
T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,637,988.24	
T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,261,562.48	
T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,698,671.91	
T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,421,875.04	
T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,562,315.62	
T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,795,527.33	
T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,739,648.45	
T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,238,289.04	
T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,940,625.04	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,735,976.57	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,640,156.24	
T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	10,464,550.81	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,739,136.73	
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,597,765.62	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,083,828.12	
T 0.5% 06/30/27	3,100,000.00	2,726,062.50	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,079,502.35	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,534,960.97	
T 0.625% 03/31/27	4,500,000.00	4,009,218.75	
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	11,704,101.63	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,240,312.48	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,860,617.18	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,189,453.12	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,739,453.10	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,467,050.76	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,086,914.09	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,745,703.14	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,653,125.00	
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,743,118.75	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,307,242.94	

T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,270,940.43
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,330,625.04
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,468,437.50
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,367,742.18
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,489,218.78
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,867,750.00
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,094,257.85
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,173,750.00
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,190,186.72
T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	5,046,125.00
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,068,155.05
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,643,248.03
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,201,250.00
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,479,910.19
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,192,187.52
T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,528,847.68
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,488,237.29
T 1.25% 08/15/31	16,120,000.00	13,812,825.00
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,961,074.25
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,467,617.17
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,577,146.49
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,839,687.52
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,946,289.05
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,485,273.48
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,465,625.00
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,938,906.24
T 1.375% 11/15/31	18,030,000.00	15,567,778.12
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,326,093.78
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,407,703.12
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,591,953.14
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,790,144.56
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,032,128.92
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,240,019.51
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,501,968.72
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,796,582.05
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,693,734.37
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,147,987.50
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,917,402.39
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	992,812.50
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,130,898.43
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,466,894.52
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,632,875.00
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,833,773.47

T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,492,079.71	
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,348,343.74	
T 1.75% 08/15/41	14,500,000.00	11,057,382.88	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,745,000.00	
T 1.875% 02/15/32	5,020,000.00	4,528,589.08	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	6,216,312.50	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,930,406.25	
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,790,937.52	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,950,570.71	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,872,734.36	
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	6,953,203.12	
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,177,500.00	
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,626,875.04	
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,049,099.60	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,317,328.16	
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,342,625.00	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,473,437.50	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,729,687.48	
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,917,382.80	
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,661,208.59	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,971,015.64	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,620,668.01	
T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,887,437.50	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,283,789.10	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,932,597.63	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,397,128.12	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,201,654.27	
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,386,043.75	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,508,281.25	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,205,500.00	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,991,406.25	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,285,875.00	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,322,783.18	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,471,171.87	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,308,875.00	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,675,429.71	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,726,812.49	
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,684,476.58	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,535,914.05	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,303,225.36	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,655,807.81	
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	6,859,371.12	



T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,947,851.55
T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	5,144,015.62
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,457,461.91
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,941,015.65
T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,453,633.60
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	3,399,687.52
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,857,722.67
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	4,292,105.49
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,549,644.55
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,622,214.86
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,967,939.12
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,183,164.06
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	4,911,580.07
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,498,906.25
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,739,747.67
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,001,406.25
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,429,490.21
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	3,894,171.07
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,460,253.92
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,003,164.06
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,169,187.50
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,630,761.73
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,504,101.57
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,842,050.76
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,324,984.38
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,519,118.76
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,736,898.43
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,986,875.00
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,166,981.25
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,794,332.05
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	5,192,284.37
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,807,614.83
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,438,671.87
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,867,325.00
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,094,257.82
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,770,039.06
T 2.875% 10/31/23	7,900,000.00	7,929,162.13
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,284,960.95
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,033,661.72
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,456,933.57
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,252,465.62
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,862,500.00
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,141,538.85

T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,259,768.16	
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,411,054.71	
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,674,956.62	
T 2% 08/15/51	15,150,000.00	11,670,234.37	
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,754,510.98	
T 2% 11/15/41	5,700,000.00	4,543,968.75	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,007,343.75	
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,905,937.50	
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,743,760.93	
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	3,932,353.12	
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,403,281.29	
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,681,230.47	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,978,253.92	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,393,164.08	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	800,980.47	
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,468,625.00	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,057,968.76	
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,097,812.50	
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,145,781.25	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,560,335.93	
T 3% 02/15/47	800,000.00	749,125.00	
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,199,339.86	
T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,765,625.00	
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,521,787.50	
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,325,195.32	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	3,007,870.31	
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	5,157,062.50	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,196,718.75	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,992,968.75	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,601,375.00	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,024,031.25	
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,645,585.93	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,157,656.25	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,185,000.00	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,225,742.18	
T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,408,856.26	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,278,961.72	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	645,261.72	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,991,257.82	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,638,642.19	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	899,707.03	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,354,289.06	

	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,462,601.56
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,292,925.79
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,873,187.50
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,667,046.87
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,285,839.84
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,723,025.38
	アメリカドル 小計	1,260,100,000.00	1,164,962,665.43 (156,361,288,954)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,051,612.40
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,283,960.00
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,319,431.20
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,282,492.80
	CAN 0.5% 12/01/30	2,590,000.00	2,065,887.60
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,252,836.00
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	664,286.00
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,371,945.60
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,731,408.40
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,118,050.80
	CAN 1.5% 04/01/25	2,710,000.00	2,593,388.70
	CAN 1.5% 05/01/24	490,000.00	475,986.00
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,055,758.30
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,278,726.40
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,434,645.50
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,160,184.00
	CAN 1.5% 12/01/31	4,170,000.00	3,584,698.80
	CAN 1.75% 12/01/53	2,260,000.00	1,637,437.80
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	730,555.20
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,401,296.40
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,270,813.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,758,726.00
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,185,912.00
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,316,261.10
	CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,528,824.00
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	690,756.40
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,226,697.10
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,155,053.10
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,420,140.80
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,683,078.70
	CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,364,077.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,163,620.50
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,355,445.00
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,176,096.00
	CAN 5% 06/01/37	420,000.00	506,910.60

	カナダドル 小計	65,490,000.00	60,296,999.20 (6,369,774,995)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,274,698.00
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	31,062,406.40
	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,762,500.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	47,710,000.00	42,552,549.00
	MBONO 5% 03/06/25	5,200,000.00	4,669,704.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,515,089.50
	MBONO 7.75% 05/29/31	45,510,000.00	42,180,943.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,040,000.00	21,073,944.80
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	9,655,540.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	38,660,000.00	37,676,489.60
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	25,588,531.50
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,595,151.40
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	25,349,840.00
	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,569,705.30
		メキシコペソ 小計	380,850,000.00
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,199,955.60
	BGB 0.2% 10/22/23	1,030,000.00	1,025,838.80
	BGB 0.35% 06/22/32	1,030,000.00	872,873.50
	BGB 0.4% 06/22/40	1,240,000.00	888,187.20
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,602,487.80
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	302,009.60
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,651,752.80
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,638,302.90
	BGB 0.8% 06/22/28	1,860,000.00	1,783,107.60
	BGB 0.9% 06/22/29	2,060,000.00	1,957,226.60
	BGB 0% 10/22/27	430,000.00	397,698.40
	BGB 0% 10/22/31	1,680,000.00	1,403,976.00
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,398,945.00
	BGB 1.4% 06/22/53	800,000.00	608,000.00
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	720,600.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	1,039,368.00
	BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,094,964.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,000,261.50
	BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,253,278.40
	BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,921,208.40
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	788,145.60
	BGB 2.25% 06/22/23	1,180,000.00	1,202,030.60
	BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	723,415.00
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,215,627.60

BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,478,772.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,128,395.90
BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	2,392,459.30
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,279,171.20
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,277,877.60
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,407,168.00
BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	3,024,952.60
BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,828,947.00
BKO 0% 06/16/23	1,090,000.00	1,086,457.50
BKO 0% 09/15/23	3,150,000.00	3,133,651.50
BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,866,783.60
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,443,758.40
BTPS 0.3% 08/15/23	2,900,000.00	2,881,150.00
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	554,543.80
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,738,489.50
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,781,476.10
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	1,970,125.20
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,108,878.90
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,451,180.40
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	666,737.10
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,073,532.50
BTPS 0.9% 04/01/31	3,830,000.00	3,095,176.20
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	703,708.20
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	1,995,069.00
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,848,692.30
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,164,562.40
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,700,893.40
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	978,600.00
BTPS 0% 01/30/24	940,000.00	919,160.20
BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,504,802.80
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,913,270.00
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,317,149.60
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,442,520.00
BTPS 0% 11/29/23	1,750,000.00	1,716,505.00
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,751,752.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,837,914.00
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,684,385.60
BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,291,337.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,248,641.00
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,366,784.00
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	820,600.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,361,077.00
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,733,412.10

BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	2,554,767.60	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,215,845.20	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,060,164.00	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	999,740.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,654,433.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,460,020.50	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,664,981.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,642,099.80	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,141,568.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	465,725.40	
BTPS 2.15% 09/01/52	920,000.00	636,492.80	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,221,996.80	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,250,000.00	1,887,817.50	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,358,417.60	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,377,808.20	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	2,961,623.40	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	2,962,803.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,984,898.50	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	1,828,973.90	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	879,286.90	
BTPS 2.8% 12/01/28	3,190,000.00	3,151,560.50	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	1,851,580.50	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,161,599.60	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,064,021.30	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,291,759.80	
BTPS 3.25% 03/01/38	500,000.00	466,815.00	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	1,786,648.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,754,152.40	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	1,991,146.40	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,050,288.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,239,956.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	1,859,144.40	
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,328,920.00	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,894,402.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,236,644.80	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,811,220.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,892,526.60	
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,397,864.00	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,664,523.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,460,620.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,070,076.80	
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,719,606.80	

BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,944,125.80
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,369,672.90
BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,595,353.60
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,273,452.00
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,532,851.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,675,618.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	886,624.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,734,283.30
DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,880,693.20
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,474,225.10
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,046,212.40
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,941,770.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,532,358.40
DBR 0.5% 08/15/27	1,940,000.00	1,871,925.40
DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,236,165.10
DBR 0% 02/15/31	3,120,000.00	2,777,112.00
DBR 0% 02/15/32	2,790,000.00	2,433,242.70
DBR 0% 05/15/35	2,260,000.00	1,853,109.60
DBR 0% 05/15/36	3,380,000.00	2,722,860.40
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,156,555.50
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,192,490.00
DBR 0% 08/15/30	4,190,000.00	3,762,913.30
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	602,618.10
DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,851,106.20
DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	2,828,004.40
DBR 0% 08/15/52	1,640,000.00	1,010,748.40
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,771,921.60
DBR 0% 11/15/28	2,500,000.00	2,307,200.00
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,331,011.00
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,323,273.70
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,681,416.00
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,007,360.00
DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,642,038.40
DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	3,945,580.80
DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	4,537,976.70
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	2,915,855.80
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,865,260.10
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	3,862,882.70
DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	3,002,819.00
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,075,325.50
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,076,446.40
DBR 4.75% 07/04/40	2,480,000.00	3,701,524.00
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,795,489.60

DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,920,830.40	
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,520,312.40	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,695,075.00	
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,234,819.60	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,449,931.20	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,490,274.40	
FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,480,803.70	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	4,955,705.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	3,160,000.00	2,339,063.60	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	437,421.60	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,364,398.20	
FRTR 0.75% 02/25/28	1,500,000.00	1,432,290.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,007,516.10	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,350,000.00	2,181,185.00	
FRTR 0.75% 05/25/53	2,560,000.00	1,629,260.80	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,550,889.50	
FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,796,165.00	
FRTR 0% 02/25/25	2,050,000.00	1,988,500.00	
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	4,970,965.20	
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,262,505.60	
FRTR 0% 03/25/24	3,750,000.00	3,700,800.00	
FRTR 0% 03/25/25	6,390,000.00	6,200,536.50	
FRTR 0% 05/25/32	2,780,000.00	2,288,635.00	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,640,529.80	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,191,923.60	
FRTR 0% 11/25/31	4,990,000.00	4,176,131.00	
FRTR 1.25% 05/25/34	4,090,000.00	3,731,184.30	
FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,574,934.00	
FRTR 1.5% 05/25/31	6,770,000.00	6,597,026.50	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	2,960,385.80	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,452,693.60	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,320,000.00	3,124,219.60	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,237,043.20	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,550,629.50	
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,240,400.00	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,211,315.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	7,180,000.00	7,614,102.80	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,110,000.00	5,446,595.70	
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,302,861.20	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,400,000.00	3,957,736.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,050,000.00	5,475,109.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,938,884.50	



FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	6,031,171.60
FRTR 4.75% 04/25/35	3,630,000.00	4,721,541.00
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,250,423.00
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,782,683.40
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	4,213,275.10
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,471,030.50
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,880,613.20
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,202,404.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	876,004.20
IRISH 0.2% 10/18/30	1,090,000.00	953,913.50
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	396,369.80
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	492,270.00
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	368,225.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	740,254.90
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	708,687.50
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,159,536.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	619,910.80
IRISH 1.35% 03/18/31	810,000.00	779,292.90
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	652,464.00
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	773,087.80
IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,626,699.60
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,275,158.50
IRISH 2% 02/18/45	1,280,000.00	1,207,526.40
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,015,939.20
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,297,599.20
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,252,226.90
NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,436,345.90
NETHER 0.5% 01/15/40	1,310,000.00	1,035,293.00
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,254,042.40
NETHER 0.5% 07/15/32	700,000.00	620,627.00
NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,513,761.60
NETHER 0.75% 07/15/28	2,080,000.00	1,997,132.80
NETHER 0% 01/15/24	2,230,000.00	2,207,053.30
NETHER 0% 01/15/26	790,000.00	756,377.60
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,732,691.20
NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,257,824.90
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	715,632.00
NETHER 0% 01/15/52	1,490,000.00	864,542.70
NETHER 0% 07/15/30	1,500,000.00	1,322,235.00
NETHER 0% 07/15/31	1,820,000.00	1,572,461.80
NETHER 1.75% 07/15/23	1,540,000.00	1,561,852.60
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,166,732.80
NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,754,036.70

NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,037,003.80	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	2,922,457.50	
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,772,415.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,110,980.60	
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,288,474.90	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,948,090.30	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,652,050.00	
OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,038,785.00	
OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	2,762,337.00	
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,386,810.00	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,502,012.10	
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,361,293.90	
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	461,550.00	
RAGB 0.5% 02/20/29	2,220,000.00	2,057,185.20	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,043,489.70	
RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	234,484.80	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,158,744.40	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	545,196.60	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,028,832.00	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	144,556.50	
RAGB 0.9% 02/20/32	510,000.00	462,978.00	
RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,267,459.50	
RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,396,082.80	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	901,449.00	
RAGB 0% 07/15/23	1,120,000.00	1,114,310.40	
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,415,131.20	
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	449,844.70	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,072,707.10	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	908,923.50	
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	191,332.80	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,007,661.60	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,352,955.80	
RAGB 1.85% 05/23/49	540,000.00	505,391.40	
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	689,326.20	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,125,090.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	987,226.90	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	587,836.20	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,299,934.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,558,553.10	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,463,967.00	
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	337,352.40	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	259,145.60	

RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	460,161.00
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	358,930.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	601,393.80
RFGB 0.5% 04/15/43	440,000.00	315,273.20
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	827,561.40
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	607,009.00
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	698,903.60
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	731,088.00
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	682,686.00
RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	567,007.50
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	411,377.40
RFGB 0% 09/15/26	200,000.00	188,608.00
RFGB 0% 09/15/30	800,000.00	690,224.00
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	506,363.20
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	424,349.80
RFGB 2.625% 07/04/42	640,000.00	685,862.40
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	588,296.50
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	746,753.50
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	901,936.10
SPGB 0.1% 04/30/31	3,180,000.00	2,588,583.60
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,243,902.30
SPGB 0.35% 07/30/23	2,020,000.00	2,015,899.40
SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	2,967,894.00
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,137,803.10
SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	2,628,568.00
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,837,330.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,300,651.60
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,089,583.40
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,197,418.40
SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,554,270.40
SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,425,528.00
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,720,730.10
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,064,149.70
SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	1,685,327.20
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,793,647.50
SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,166,190.00
SPGB 1.4% 04/30/28	3,070,000.00	2,959,817.70
SPGB 1.4% 07/30/28	3,570,000.00	3,430,627.20
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,568,627.20
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	2,953,694.40
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	357,053.40
SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,597,901.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,060,980.00

	SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,465,127.50
	SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	667,350.00
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	2,830,794.00
	SPGB 1.95% 07/30/30	1,990,000.00	1,935,374.50
	SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	624,797.80
	SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	1,491,361.30
	SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,861,928.80
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,367,092.80
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	1,724,570.00
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,158,305.50
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,146,056.00
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,784,895.00
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,648,217.60
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	2,952,535.30
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,824,715.20
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,106,960.00
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,240,000.00	2,819,712.00
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,549,424.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	2,888,775.00
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	4,118,583.90
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,354,394.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,683,022.20
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,400,291.40
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,305,433.50
	ユーロ 小計	776,320,000.00	764,493,421.40 (108,970,892,286)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,425,516.80
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,206,478.00
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,033,502.80
	UKT 0.25% 01/31/25	1,110,000.00	1,059,162.00
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,722,307.70
	UKT 0.375% 10/22/26	1,910,000.00	1,779,184.10
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,089,766.80
	UKT 0.5% 01/31/29	1,650,000.00	1,483,119.00
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	712,813.00
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,638,188.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,810,000.00	2,220,658.70
	UKT 0.625% 10/22/50	880,000.00	550,633.60
	UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,333,898.40
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	826,511.40
	UKT 0.875% 07/31/33	510,000.00	434,514.90
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,557,795.00

UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	404,155.00	
UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	344,494.80	
UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	917,510.00	
UKT 1.25% 07/31/51	1,180,000.00	878,368.40	
UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,247,700.00	
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,572,944.00	
UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,920,339.90	
UKT 1.5% 07/31/53	420,000.00	333,202.80	
UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,583,452.80	
UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	1,517,685.60	
UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	1,198,755.60	
UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,109,199.00	
UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	1,867,030.10	
UKT 1.75% 09/07/37	2,630,000.00	2,371,102.80	
UKT 1% 01/31/32	400,000.00	353,384.00	
UKT 1% 04/22/24	800,000.00	787,768.00	
UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,511,625.00	
UKT 2.5% 07/22/65	1,510,000.00	1,583,944.70	
UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,719,760.90	
UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,784,094.00	
UKT 3.25% 01/22/44	2,380,000.00	2,653,438.20	
UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,658,048.80	
UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	2,571,416.20	
UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,031,376.00	
UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	1,976,282.00	
UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,459,268.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,008,103.40	
UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,528,070.60	
UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,188,410.00	
UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	2,515,046.40	
UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,026,163.30	
UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,703,108.40	
UKT 4.5% 09/07/34	1,860,000.00	2,261,388.00	
UKT 4.5% 12/07/42	2,210,000.00	2,893,774.00	
UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,752,073.00	
UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,147,277.00	
UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,166,271.80	
UKT 5% 03/07/25	2,300,000.00	2,484,966.00	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,548,187.50	
イギリスポンド 小計	94,320,000.00	95,653,236.20 (16,042,004,243)	
スウェーデン ンクローナ			
SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,571,446.40	
SGB 0.75% 05/12/28	7,800,000.00	7,339,644.00	

	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	7,000,862.40	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,518,250.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,180,000.00	8,872,837.20	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,509,562.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,498,276.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,457,331.70	
スウェーデンクローナ 小計		63,420,000.00	62,768,209.70	(849,253,877)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,590,000.00	3,090,954.10	
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,733,309.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	6,470,000.00	6,157,175.50	
	NGB 1.75% 02/17/27	5,130,000.00	4,866,420.60	
	NGB 1.75% 03/13/25	5,720,000.00	5,560,583.60	
	NGB 1.75% 09/06/29	6,340,000.00	5,835,082.40	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,220,000.00	2,977,115.40	
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,762,875.60	
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,819,208.80	
ノルウェークローネ 小計		49,730,000.00	46,802,725.60	(654,302,103)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,050,000.00	3,770,541.50	
	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,368,294.50	
	DGB 0.5% 11/15/29	11,410,000.00	10,489,098.90	
	DGB 0% 11/15/24	2,550,000.00	2,482,297.50	
	DGB 0% 11/15/31	6,690,000.00	5,667,299.70	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,643,167.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,595,349.90	
	DGB 4.5% 11/15/39	13,290,000.00	18,343,256.70	
デンマーククローネ 小計		61,900,000.00	62,359,305.70	(1,194,804,297)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,850,000.00	2,138,953.50	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,015,213.20	
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,868,356.80	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,706,879.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	980,000.00	626,435.60	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,552,484.20	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,286,093.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,860,000.00	5,756,706.20	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,044,412.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,604,772.50	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,764,022.40	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,404,564.60	
	POLGB 3.75% 05/25/27	100,000.00	86,165.00	

	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,330,686.90	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	565,590.00	
ポーランドズロチ 小計		51,810,000.00	42,751,334.90 (1,324,000,291)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,215,659.30	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,115,009.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,660,000.00	2,365,830.60	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,198,658.20	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,672,964.80	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,230,383.20	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,910,000.00	2,432,119.80	
	ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	2,572,862.50	
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,912,260.80	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,140,000.00	1,067,518.80	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,520,000.00	3,260,998.40	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,379,972.40	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,373,633.60	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	940,569.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,869,127.80	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,590,844.40	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,336,581.30	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,570,470.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,165,702.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,032,852.80	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,606,197.60	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,426,370.40	
	ACGB 3% 11/21/33	1,000,000.00	936,580.00	
ACGB 4.25% 04/21/26	1,890,000.00	1,957,076.10		
ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,483,319.30		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,466,948.80		
オーストラリアドル 小計		55,270,000.00	50,180,511.30 (4,776,682,870)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	700,297.50	
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	499,689.30	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	583,778.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	655,970.40	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	261,814.40	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,059,750.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	809,935.60	
	SIGB 2.375% 06/01/25	730,000.00	727,547.20	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	392,779.20	
	SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	605,961.80	
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	729,714.00	

	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	603,766.80
	SIGB 2.75% 07/01/23	620,000.00	624,253.20
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	651,943.50
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,200,000.00	1,196,508.00
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	677,939.60
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	859,224.30
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	911,750.40
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,611,306.00
	シンガポールドル 小計	14,640,000.00	14,163,929.20 (1,376,025,721)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,510,000.00	1,337,271.10
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,927,315.20
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,487,048.00
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,570,768.00
	MGS 3.757% 05/22/40	1,520,000.00	1,347,221.60
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	941,187.90
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,660,366.20
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,595,601.50
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,041,350.60
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,477,305.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,133,672.50
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,973,250.50
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,135,052.00
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	604,224.00
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,156,192.00
	MGS 4.059% 09/30/24	1,780,000.00	1,810,509.20
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,040,807.60
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,301,376.00
	MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	3,009,180.00
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	1,976,265.90
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,562,275.00
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,920,288.80
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,806,125.70
MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,447,499.20	
MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,325,326.40	
MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,369,759.70	
MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,678,706.40	
MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,042,782.30	
	マレーシアリンギット 小計	52,260,000.00	51,678,728.30 (1,576,831,693)
イスラエル シェゲル	ILGOV 0.15% 07/31/23	840,000.00	826,312.62
	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,210,000.00	1,156,417.68
	ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	795,889.32



	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,290,952.77	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	280,000.00	240,241.14	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	1,715,950.41	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,232,251.40	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,220,509.06	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,466,217.08	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	1,949,205.74	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,668,076.40	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,200,382.44	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,202,007.21	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,745,486.93	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	3,060,000.00	3,507,636.07	
	イスラエルシェケル 小計	31,260,000.00	31,217,536.27	(1,245,820,072)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,185,833.60	
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,708,245.00	
	CGB 2.47% 09/02/24	18,980,000.00	19,055,540.40	
	CGB 2.48% 04/15/27	9,000,000.00	8,972,820.00	
	CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,602,549.60	
	CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,238,789.60	
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,337,061.20	
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,126,852.40	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,776,519.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	12,330,000.00	12,465,630.00	
	CGB 2.89% 11/18/31	9,510,000.00	9,559,547.10	
	CGB 2.91% 10/14/28	10,280,000.00	10,380,949.60	
	CGB 3.01% 05/13/28	7,230,000.00	7,350,957.90	
	CGB 3.02% 05/27/31	6,850,000.00	6,951,585.50	
	CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	47,644,231.60	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,097,216.50	
	CGB 3.28% 12/03/27	5,410,000.00	5,589,990.70	
	CGB 3.39% 03/16/50	5,520,000.00	5,573,544.00	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	7,751,278.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,559,642.20	
	CGB 3.81% 09/14/50	7,460,000.00	8,103,350.40	
	CGB 3.86% 07/22/49	5,580,000.00	6,098,716.80	
	CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,649,766.30	
	オフショア人民元 小計	309,820,000.00	313,780,617.40	(6,288,728,377)
	合計		309,477,572,304	(309,477,572,304)

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 222銘柄	100.0%	50.5%
カナダドル	国債証券 35銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 346銘柄	100.0%	35.2%
イギリスポンド	国債証券 55銘柄	100.0%	5.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券 23銘柄	100.0%	2.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,659,328,061
コール・ローン	36,788,052
株式	110,066,506,884
投資信託受益証券	259,108,910
投資証券	123,231,485

	2022年 6月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	51,582,761
未収入金	374,111
未収配当金	297,659,789
差入委託証拠金	1,732,107,444
流動資産合計	114,226,687,497
資産合計	114,226,687,497
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,795,742
前受金	14,785,675
未払解約金	23,910,751
未払利息	41
流動負債合計	75,492,209
負債合計	75,492,209
純資産の部	
元本等	
元本	30,557,293,977
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	83,593,901,311
元本等合計	114,151,195,288
純資産合計	114,151,195,288
負債純資産合計	114,226,687,497

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 6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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <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> <p>(1) 先物取引</p>

2022年 6月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<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 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 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</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 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	30,557,293,977口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.7356円 (1万口当たり純資産額) (37,356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 6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 6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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月11日
期首元本額	26,074,272,136円
期中追加設定元本額	5,452,163,273円
期中一部解約元本額	969,141,432円
期末元本額	30,557,293,977円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,898,812,054円
世界経済インデックスファンド	5,863,819,620円
DC 新興国株式インデックス・オープン	5,279,715,957円
DC 世界経済インデックスファンド	5,352,133,218円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	164,993,255円
分散投資コア戦略ファンドA	223,488,884円
分散投資コア戦略ファンドS	1,319,362,044円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	738,649,863円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	600,621,904円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	336,578,159円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	16,920,572円
SMT インデックスバランス・オープン	83,491,178円
SMT 世界経済インデックス・オープン	159,449,064円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	626,469,200円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	107,346,311円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,509,412円
グローバル経済コア	353,326,960円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	45,487,451円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	22,150,179円

区分	2022年 6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）2040	18,392,969円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	7,813,731円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	8,936,535円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,079,322,250円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	185,409,961円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	50,018,328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）	10,074,918円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	15,209,277,382
投資信託受益証券	29,913,058
投資証券	141,856
合計	15,239,048,584

(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 6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	3,611,191,784	-	3,625,977,459	14,785,675
	合計	3,611,191,784	-	3,625,977,459	14,785,675

## (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 6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	56,364,000	-	56,362,656	1,344
	アメリカドル	56,364,000	-	56,362,656	1,344
合計	56,364,000	-	56,362,656	1,344	

## (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	GAZPROM OAO-SPON ADR	655,305	0.00	0.06	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.67	233,216.20	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,590	0.00	-	
	ROSNEFT OJSC-GDR	134,073	0.00	0.01	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	0.00	0.01	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	29,910	0.00	-	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	7.87	133,239.10	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	72,204	0.00	-	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	0.00	-	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	0.00	-	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,938	0.00	-	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	-	
	SOUTHERN COPPER CORP	17,657	61.10	1,078,842.70	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	53,727	26.09	1,401,737.43	
	LI AUTO INC - ADR	60,121	29.49	1,772,968.29	
	NIO INC - ADR	147,534	18.82	2,776,589.88	
	XPENG INC - ADR	43,999	26.01	1,144,413.99	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	19,163	32.71	626,821.73	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	4.16	170,801.28	
	TRIP.COM GROUP LTD	55,661	23.04	1,282,429.44	
YUM CHINA HOLDINGS INC	50,479	43.56	2,198,865.24		
AUTOHOME INC-ADR	6,571	36.46	239,578.66		



	IQIYI INC-ADR	28,984	4.54	131,587.36
	JOYY INC	6,185	34.59	213,970.07
	KANZHUN LTD	6,900	23.53	162,357.00
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	4.45	505,284.15
	VK CO LTD	19,368	0.00	-
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	23.80	124,926.20
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	-
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-
	PINDUODUO INC-ADR	53,748	58.70	3,155,007.60
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	10.37	547,173.05
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,926	0.00	-
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	68,136	2.16	147,173.76
	BEIGENE LTD-ADR	4,929	150.64	742,504.56
	HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	10.32	74,747.76
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	3,311	45.75	151,478.25
	ZAI LAB LTD-ADR	12,825	27.00	346,275.00
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	189,281	1.97	372,883.57
	CREDICORP LTD	8,778	131.46	1,153,955.88
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-
	360 DIGITECH INC	8,061	16.94	136,553.34
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	75,232	6.25	470,200.00
	KE HOLDINGS INC	35,144	15.33	538,757.52
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	422,032	0.92	392,067.72
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	79,000	3.97	314,183.00
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	39,854	0.00	-
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	60.99	477,856.65
	アメリカドル 小計	3,113,340		23,218,446.46 (3,116,379,883)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,071,161	8.16	8,740,673.76
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	377,892	93.81	35,450,048.52
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	203.00	2,943,500.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	52.20	5,055,674.40
	ALFA S.A.B. -A	313,500	14.11	4,423,485.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	78.48	2,943,000.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	421.23	9,816,765.15
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	285.14	12,454,915.20
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	138.98	5,932,361.30
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	288,490	36.17	10,434,683.30
	WALMART DE MEXICO-SER V	567,680	68.60	38,942,848.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	128.05	6,463,323.75
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	207,440	143.59	29,786,309.60
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	235.44	6,112,022.40

	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	64.52	11,729,736.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	29.33	5,332,194.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	282,600	120.85	34,152,210.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	35.59	8,986,475.00
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,513,640	19.49	68,480,843.60
	メキシコペソ 小計	7,573,460		308,181,068.98 (2,103,520,704)
ブラジルリアル	COSAN SA	118,300	20.03	2,369,549.00
	PETRO RIO SA	84,700	27.22	2,305,534.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	403,900	33.33	13,461,987.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	544,440	30.07	16,371,310.80
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	12.97	980,532.00
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	44.51	859,043.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	19.64	1,952,216.00
	GERDAU SA-PREF	141,800	27.64	3,919,352.00
	SUZANO SA	90,079	51.85	4,670,596.15
	VALE SA	477,787	84.54	40,392,112.98
	WEG SA	217,544	24.52	5,334,178.88
	CCR SA	125,600	13.23	1,661,688.00
	LOCALIZA RENT A CAR	75,752	52.91	4,008,038.32
	RUMO SA	159,700	17.93	2,863,421.00
	AMERICANAS SA	73,040	17.03	1,243,871.20
	LOJAS RENNER S.A.	115,947	25.22	2,924,183.34
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	3.01	919,555.00
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	18.14	3,138,220.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	18.22	756,130.00
	RAIA DROGASIL SA	122,500	20.65	2,529,625.00
	AMBEV SA	534,900	13.61	7,279,989.00
	BRF SA	52,500	14.96	785,400.00
	JBS SA	110,000	34.75	3,822,500.00
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	16.52	1,657,088.16
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	510,254	6.23	3,178,882.42
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,600	34.00	1,550,400.00
	HYPERA SA	54,500	38.68	2,108,060.00
	BANCO BRADESCO S.A.	261,323	16.12	4,212,526.76
	BANCO BRADESCO SA-PREF	584,982	19.40	11,348,650.80
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	35.14	3,102,862.00
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	575,881	24.64	14,189,707.84
	ITAUSA SA	528,325	9.07	4,791,907.75
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	715,509	11.95	8,550,332.55
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	25.16	1,736,040.00
	TOTVS SA	57,900	27.51	1,592,829.00

	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	46.87	2,451,301.00	
	TIM SA	96,100	12.98	1,247,378.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	42.50	1,572,500.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	43.04	1,446,144.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	11.07	2,344,924.89	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	44.03	2,223,515.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	32.99	897,328.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	41.82	1,934,175.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	24.21	3,997,071.00	
	ブラジルリアル 小計	8,474,548		200,682,656.84 (5,488,108,753)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,593.80	294,940,674.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,398.10	190,092,666.50	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	18,037	79,100.00	1,426,726,700.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	115.33	283,848,812.04	
	FALABELLA SA	70,837	2,158.80	152,922,915.60	
	CENCOSUD SA	137,988	1,310.30	180,805,676.40	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	5,790.00	42,759,150.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	82.51	401,216,426.40	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,718	29,850.00	170,682,300.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	39.49	247,990,131.29	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	88.20	307,933,983.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	24.25	62,110,991.50	
	チリペソ 小計	20,076,902		3,762,030,426.73 (611,992,061)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	3,175.00	1,552,508,325.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	42,650.00	1,252,886,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	39,600.00	2,437,974,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	21,620.00	1,092,047,820.00	
	コロンビアペソ 小計	630,431		6,335,416,545.00 (221,220,074)	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	9,898	16.96	167,870.08	
	OPAP SA	18,496	14.14	261,533.44	
	JUMBO SA	19,341	15.14	292,822.74	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	0.94	248,058.85	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	0.98	279,098.92	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	17.30	453,381.10	
	PUBLIC POWER CORP	20,834	5.87	122,399.75	
	ユーロ 小計	641,219		1,825,164.88 (260,159,001)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	278.70	3,233,756.10	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	33.92	3,960,329.60	

	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	23.70	2,359,714.20	
	KOC HOLDING AS	89,884	39.32	3,534,238.88	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	22.96	6,859,254.08	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	297.20	1,932,097.20	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	82.30	3,524,415.20	
	AKBANK T.A.S.	276,321	8.37	2,312,806.77	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	10.42	1,802,785.04	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	18.17	2,599,963.47	
	トルコリラ 小計	1,258,305		32,119,360.54	(250,241,937)
チェココルナ	CEZ AS	8,425	1,216.00	10,244,800.00	
	チェココルナ 小計	8,425		10,244,800.00	(59,162,695)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	9,413	2,746.00	25,848,098.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	6,865.00	104,196,970.00	
	OTP BANK NYRT	11,388	8,900.00	101,353,200.00	
	ハンガリーフォリント 小計	35,979		231,398,268.00	(83,485,255)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	73.22	2,248,805.86	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	200,051	5.84	1,169,898.24	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	146.65	2,960,276.90	
	LPP SA	124	10,280.00	1,274,720.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	93.95	629,840.80	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	19.42	701,023.16	
	ALLEGRO.EU SA	39,203	20.79	815,226.38	
	DINO POLSKA SA	5,945	306.50	1,822,142.50	
	BANK PEKAO SA	14,499	87.48	1,268,372.52	
	M BANK SA	1,423	256.20	364,572.60	
	PKO BANK POLSKI SA	93,312	29.73	2,774,165.76	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	911	240.80	219,368.80	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	48,568	30.21	1,467,239.28	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	5.82	324,040.87	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	10.26	651,786.44	
	ポーランドズロチ 小計	616,891		18,691,480.11	(578,871,400)
ロシアルーブル	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	-	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11	
	VTB BANK PJSC	756,074,000	0.00	75.60	
	ロシアルーブル 小計	757,259,509		75.71	(187)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	7.89	2,595,810.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	342,000	9.90	3,385,800.00	

CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,915,400	3.79	11,049,366.00
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	460,000	27.50	12,650,000.00
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	236,000	4.65	1,097,400.00
PETROCHINA CO LTD-H	2,648,000	4.36	11,545,280.00
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	142,000	29.00	4,118,000.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.65	1,241,000.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	33.90	4,898,550.00
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	9.77	2,139,630.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	810,000	4.22	3,418,200.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	8.65	3,563,800.00
CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	5.35	1,540,800.00
DONGYUE GROUP	147,000	10.76	1,581,720.00
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	38,600	109.00	4,207,400.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	223,000	12.78	2,849,940.00
MMG LIMITED	304,000	3.35	1,018,400.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	7.05	909,450.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	141,750	13.82	1,958,985.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	7.11	1,286,910.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	10.84	7,902,360.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	4.31	1,185,250.00
BOC AVIATION LTD	23,800	64.25	1,529,150.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.66	717,360.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	18.00	4,374,000.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	10.34	1,323,520.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	5.13	3,621,780.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	8.78	1,492,600.00
CITIC LTD	617,000	8.77	5,411,090.00
CRRG CORP LTD-H	409,000	3.13	1,280,170.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	7.66	2,206,080.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	21.25	1,657,500.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	7.72	1,235,200.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	10.84	590,780.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	12.20	2,583,960.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	12.34	1,742,605.44
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	33.60	2,093,280.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	4.37	507,794.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	4.58	1,763,638.92
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.57	1,191,980.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.63	1,148,240.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	15.10	2,499,759.70
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.22	742,720.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	13.22	6,848,621.00

COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	6.02	1,509,659.48
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	7.80	2,511,600.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	243.20	4,256,000.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	7.47	955,577.34
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	7.12	2,207,200.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	5.47	2,014,800.00
BYD CO LTD-H	102,000	300.00	30,600,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	6.14	1,633,240.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	39.55	2,309,720.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	630,000	14.56	9,172,800.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	14.22	5,016,105.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	7.57	2,712,664.08
MINTH GROUP LTD	64,000	19.60	1,254,400.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	15.10	1,630,800.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	151,600	90.30	13,689,480.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	4.17	1,826,460.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	303,000	25.80	7,817,400.00
LI NING CO LTD	292,000	63.20	18,454,400.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	99,600	107.80	10,736,880.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	12.54	2,069,100.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	15.88	1,842,080.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	17.76	1,012,320.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	138,400	13.02	1,801,968.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	68,400	15.48	1,058,832.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.79	1,145,500.00
BAIDU INC-CLASS A	254,450	149.80	38,116,610.00
BILIBILI INC-CLASS Z	17,420	233.20	4,062,344.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	36.55	1,885,980.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	28.60	2,631,200.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	188,500	87.35	16,465,475.00
NETEASE INC	246,830	167.40	41,319,342.00
TENCENT HOLDINGS LTD	741,200	394.80	292,625,760.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,797,088	111.30	200,015,894.40
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	4.82	2,034,040.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	27.30	2,839,200.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	268,000	2.31	619,080.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	123,550	52.25	6,455,487.50
JD.COM INC - CL A	237,411	249.00	59,115,339.00
MEITUAN-CLASS B	485,500	201.80	97,973,900.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	21.90	1,176,030.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	34.85	2,251,310.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	6.40	729,600.00

ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	60.20	5,538,400.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	116.32	1,768,064.00
CHINA FEIHE LTD	346,000	8.05	2,785,300.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	402,000	38.95	15,657,900.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	182,000	49.95	9,090,900.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.97	976,620.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	193,000	41.95	8,096,350.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	20.05	3,909,750.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	13.52	3,082,560.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	68,000	69.15	4,702,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.22	497,600.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	7.30	4,088,000.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	24.65	1,183,200.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	36.75	3,215,625.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	18.10	452,500.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	35,200	44.90	1,580,480.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	6.08	753,920.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	17.84	1,177,440.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	8.20	3,273,440.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	12.68	1,628,112.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	18.36	3,510,432.00
3SBIO INC	119,000	6.38	759,220.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	83.00	830,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	11.30	2,791,100.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,144,160	7.55	8,638,408.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	4.04	1,963,440.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	26.70	3,524,400.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	81.25	414,375.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	13.64	1,664,080.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	139,000	27.95	3,885,050.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	73.40	2,455,230.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	31.20	2,277,600.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	4.26	4,741,380.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	42,288	107.10	4,529,044.80
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	423,000	71.10	30,075,300.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,441,000	2.95	10,150,950.00
BANK OF CHINA LTD-H	9,806,200	3.08	30,203,096.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	5.19	5,701,085.25
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.78	3,595,536.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	11,210,620	5.64	63,227,896.80
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.55	956,250.00

CHINA MERCHANTS BANK-H	455,923	49.75	22,682,169.25
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	3.05	2,056,920.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,699,515	4.57	30,616,783.55
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	5.93	6,279,870.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.32	1,098,240.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.49	2,168,670.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	203,600	15.64	3,184,304.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	16.90	4,829,597.50
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	7.32	1,756,800.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	10.22	905,492.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.67	2,025,324.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	11.36	1,540,416.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	918,000	12.18	11,181,240.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	19.22	7,430,452.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	9.22	1,696,701.28
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	21.35	2,058,140.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.53	2,375,670.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	8.16	5,624,590.08
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	727,000	48.80	35,477,600.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	27.20	1,243,040.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	104,500	13.30	1,389,850.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	2.13	1,231,140.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	468,540	22.75	10,659,285.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	9.02	2,029,500.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	367,111	34.45	12,646,973.95
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	67,600	39.75	2,687,100.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	17.66	3,150,544.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	64,000	9.50	608,000.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	564,000	3.67	2,069,880.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,016,654	4.74	4,818,939.96
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	232,000	31.40	7,284,800.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	13.72	994,700.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	8.27	1,488,600.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	66,000	12.38	817,080.00
LONGFOR PROPERTIES	229,000	36.50	8,358,500.00
SEAZEN GROUP LTD	204,000	3.45	703,800.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	75,000	4.20	315,000.00
WHARF HOLDINGS	154,000	25.10	3,865,400.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	8.38	968,728.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	7.26	2,003,760.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	61,600	32.30	1,989,680.00



	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	16.36	5,087,960.00	
	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	88,000	10.44	918,720.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	12.98	1,025,420.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	17.46	1,248,390.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	18.38	1,111,990.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	38.30	2,566,100.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	14.02	967,380.00	
	LENOVO GROUP LTD	900,000	7.72	6,948,000.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	76,800	116.80	8,970,240.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,744,000	12.18	21,241,920.00	
	ZTE CORP-H	82,908	16.98	1,407,777.84	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	0.95	4,337,700.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	27.70	1,648,150.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.48	1,512,800.00	
	CGN POWER CO LTD-H	791,000	1.96	1,550,360.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	11.92	5,559,488.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	15.74	7,114,480.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	4.10	2,730,600.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	34.65	3,672,900.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	14.98	3,855,852.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	98,600	120.30	11,861,580.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	9.53	4,250,380.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	3.67	2,583,680.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	6.61	3,622,280.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	33.05	2,115,200.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	28.70	2,583,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	625,987	14.14	8,851,456.18	
	香港ドル 小計	99,443,694		1,627,856,427.30	(27,836,344,906)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.23	922,479.64	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	21.72	545,172.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	9.64	2,601,836.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	5.02	1,448,772.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.50	286,500.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.25	756,778.50	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	6.73	717,377.62	
	MISC BHD	125,040	7.18	897,787.20	
	GENTING BHD	271,600	5.20	1,412,320.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	3.01	1,112,797.00	
	MR DIY GROUP M BHD	202,300	3.24	655,452.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	4.12	1,113,800.80	

	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	50,646	25.14	1,273,240.44	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	132.50	954,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	15.84	1,163,923.20	
	QL RESOURCES BHD	124,800	4.95	617,760.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.71	1,163,586.66	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	181,300	3.75	679,875.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.40	1,467,520.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	1.22	615,978.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.80	1,142,660.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	703,975	5.07	3,569,153.25	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	20.98	1,285,906.16	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	19.28	320,684.24	
	MALAYAN BANKING BHD	571,105	8.80	5,025,724.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,675,000	4.57	7,654,750.00	
	RHB BANK BHD	210,820	5.91	1,245,946.20	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.76	758,172.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.01	858,719.89	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	3.23	1,006,791.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.42	916,218.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.11	1,387,630.72	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.50	1,245,750.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	305,275	8.79	2,683,367.25	
	マレーシアリングット 小計	9,467,501		49,508,428.77	(1,510,611,080)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	174.00	34,939,200.00	
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	37.75	45,201,850.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	60.75	7,296,075.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	51.50	10,629,600.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	48.75	10,965,532.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	56.75	5,709,050.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	102,600	366.00	37,551,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	527,000	68.50	36,099,500.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.90	7,271,300.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	8.55	6,921,225.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	5.00	4,051,500.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	34.75	12,605,145.50	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	36.50	6,650,300.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	14.10	11,845,903.50	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	27.00	7,803,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	34.50	6,127,200.00	
	CP ALL PCL-NVDR	691,700	63.75	44,095,875.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	106.50	4,930,950.00	

	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	26.50	14,744,600.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	34.00	2,244,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	17.40	3,217,260.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	25.00	29,422,500.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	178.00	14,720,600.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	15.80	6,930,670.00	
	SCB X PCL-NVDR	88,700	113.00	10,023,100.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	19.10	3,153,410.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	72,600	73.25	5,317,950.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	61.25	6,216,875.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	49.00	4,400,200.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	54.25	4,139,275.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	62.00	14,030,600.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.80	7,673,600.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	319.00	12,409,100.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	212.00	25,376,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	70.50	8,590,425.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	4.64	4,460,937.76	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	34.75	1,855,650.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	178.50	3,016,650.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	88.25	19,406,175.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	65.25	4,450,050.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	47.25	19,037,025.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	81,450	39.50	3,217,275.00	
	タイパーツ 小計	13,988,766		528,749,134.26 (2,051,546,640)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	51.50	12,253,910.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	671.00	18,975,880.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	500.00	3,429,000.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	53.50	16,237,945.50	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	862.00	31,277,670.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	203.00	31,085,390.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	209.00	12,751,090.00	
	MONDE NISSIN CORP	490,500	15.00	7,357,500.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	105.10	10,043,356.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	97.80	20,783,967.00	
	BDO UNIBANK INC	219,911	129.80	28,544,447.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	51.80	8,354,666.60	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.80	8,951,660.00	
	AYALA LAND INC	794,100	31.70	25,172,970.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,567,750	38.60	60,515,150.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	320,000	24.00	7,680,000.00	

	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,400.00	11,256,000.00	
	PLDT INC	10,460	1,920.00	20,083,200.00	
	AC ENERGY CORP	821,840	7.65	6,287,076.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	370.00	19,676,600.00	
	フィリピンペソ 小計	7,934,509		360,717,478.90	(914,094,163)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	3,600.00	7,784,280,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	32,400.00	6,509,160,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	964,000	2,450.00	2,361,800,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,400.00	2,365,920,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	805.00	2,320,412,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,275.00	2,020,755,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	5,150.00	8,359,979,550.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	7,650.00	2,327,130,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	7,000.00	2,419,200,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,542,000	7,200.00	18,302,400,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	1,855.00	3,967,288,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	4,950.00	3,921,885,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	31,525.00	1,878,890,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,625.00	1,388,625,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,875.00	2,950,062,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	4,820.00	3,597,648,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,635.00	6,848,197,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	6,307,600	7,500.00	47,307,000,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	474,900	8,900.00	4,226,610,000.00	
	BANK MANDIRI	2,163,796	8,425.00	18,229,981,300.00	
BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,675.00	7,028,485,000.00		
PT BANK RAKYAT INDONESIA	8,237,202	4,490.00	36,985,036,980.00		
SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	940.00	2,670,164,000.00		
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,601,300	4,050.00	22,685,265,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	2,810.00	3,023,841,000.00		
	インドネシアルピア 小計	48,282,095		221,480,016,830.00	(2,059,764,156)
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	47,900.00	315,804,700.00	
	HD HYUNDAI	5,180	64,800.00	335,664,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	121,000.00	772,827,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,766	244,000.00	1,650,904,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	40,550.00	502,049,550.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	41,450.00	463,784,050.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	565,000.00	680,260,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	162,000.00	307,476,000.00	
	LG CHEM LTD	5,774	589,000.00	3,400,886,000.00	

LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	283,000.00	248,191,000.00
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	204,000.00	393,720,000.00
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	132,500.00	443,875,000.00
POSCO HOLDINGS INC	9,290	286,000.00	2,656,940,000.00
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,122	122,000.00	136,884,000.00
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	118,500.00	277,053,000.00
SKC CO LTD	1,734	160,000.00	277,440,000.00
CJ CORP	1,230	83,000.00	102,090,000.00
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	36,850.00	158,749,800.00
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	42,494	19,550.00	830,757,700.00
ECOPRO BM CO LTD	1,170	502,800.00	588,276,000.00
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	37,450.00	253,162,000.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	41,950.00	409,767,600.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	134,500.00	284,467,500.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	11,377	57,900.00	658,728,300.00
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	93,300.00	406,228,200.00
LG CORP	11,686	81,400.00	951,240,400.00
LG ENERGY SOLUTION	2,553	422,500.00	1,078,642,500.00
SAMSUNG C&T CORP	11,910	117,500.00	1,399,425,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	24,200.00	448,087,200.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	6,030.00	573,869,070.00
SK INC	4,545	249,000.00	1,131,705,000.00
S-1 CORPORATION	3,573	67,700.00	241,892,100.00
CJ LOGISTICS	862	121,000.00	104,302,000.00
HMM CO LTD	35,545	29,450.00	1,046,800,250.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	202,000.00	564,186,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	23,739	28,500.00	676,561,500.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	7,180.00	213,504,480.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	36,200.00	255,789,200.00
HANON SYSTEMS	19,000	11,400.00	216,600,000.00
HYUNDAI MOBIS	7,116	222,000.00	1,579,752,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	14,897	182,500.00	2,718,702,500.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	91,300.00	278,556,300.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	91,200.00	314,548,800.00
KIA CORP	29,259	82,200.00	2,405,089,800.00
COWAY CO LTD	9,036	66,300.00	599,086,800.00
F&F CO LTD / NEW	3,017	130,000.00	392,210,000.00
HLB INC	10,012	39,500.00	395,474,000.00
LG ELECTRONICS INC	13,527	102,500.00	1,386,517,500.00
KANGWON LAND INC	7,703	28,300.00	217,994,900.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	22,573	24,800.00	559,810,400.00
CJ ENM CO LTD	830	113,300.00	94,039,000.00

HYBE CO LTD	2,474	227,500.00	562,835,000.00
KAKAO CORP	37,877	81,300.00	3,079,400,100.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	61,600.00	186,093,600.00
KRAFTON INC	2,345	276,500.00	648,392,500.00
NAVER CORP	15,839	273,000.00	4,324,047,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,939	465,500.00	902,604,500.00
NETMARBLE CORP	2,465	81,200.00	200,158,000.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	63,400.00	291,957,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	8,618	78,000.00	672,204,000.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	106,000.00	109,604,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	184,000.00	300,288,000.00
EMART	3,594	114,000.00	409,716,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	381,500.00	295,662,500.00
KT&G CORP	18,829	85,100.00	1,602,347,900.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	93,100.00	292,520,200.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	157,000.00	590,634,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	685,000.00	654,860,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	389	387,500.00	150,737,500.00
PACIFIC CORP	3,393	43,750.00	148,443,750.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,851	63,300.00	560,268,300.00
SD BIOSENSOR INC	3,909	45,950.00	179,618,550.00
ALTEOGEN INC	2,841	53,800.00	152,845,800.00
CELLTRION INC	10,890	165,500.00	1,802,295,000.00
CELLTRION PHARM INC	1,968	82,300.00	161,966,400.00
GREEN CROSS CORP	564	179,500.00	101,238,000.00
HANMI PHARM CO LTD	1,156	307,500.00	355,470,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,993	811,000.00	1,616,323,000.00
SEEGENE INC	3,838	43,400.00	166,569,200.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	82,400.00	263,432,800.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	125,500.00	263,550,000.00
YUHAN CORPORATION	12,567	58,300.00	732,656,100.00
HANA FINANCIAL GROUP	33,962	46,550.00	1,580,931,100.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	11,000.00	311,630,000.00
KAKAObANK CORP	10,063	41,050.00	413,086,150.00
KB FINANCIAL GROUP INC	42,887	57,100.00	2,448,847,700.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	50,883	42,500.00	2,162,527,500.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	14,900.00	885,149,400.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	69,500.00	319,839,000.00
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	7,939	30,450.00	241,742,550.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	5,590.00	267,783,360.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	7,660.00	237,574,900.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	10,250.00	124,096,750.00

	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	38,150.00	220,354,400.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	65,300.00	274,847,700.00	
	MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	7,329	36,550.00	267,874,950.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	200,000.00	621,600,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	66,000.00	489,522,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	144,500.00	538,262,500.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	2,166	82,900.00	179,561,400.00	
	L&F CO LTD	3,026	242,200.00	732,897,200.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	17,200.00	414,021,200.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	376,500.00	532,747,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,845	152,000.00	1,040,440,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	568,962	65,200.00	37,096,322,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	96,421	59,500.00	5,737,049,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,526	556,000.00	3,628,456,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	13,850.00	306,431,250.00	
	SK TELECOM	9,599	55,600.00	533,704,400.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	23,250.00	615,171,750.00	
	SK HYNIX INC	65,667	105,500.00	6,927,868,500.00	
	SK SQUARE CO LTD	11,660	46,500.00	542,190,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,928,919		127,871,641,860.00 (13,592,755,529)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	97.00	10,887,280.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	44.65	10,455,958.40	
	CHINA STEEL	1,494,261	34.50	51,552,004.50	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	82.40	34,613,026.40	
	FORMOSA PLASTICS CORP	441,824	108.00	47,716,992.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	647,752	84.80	54,929,369.60	
	TAIWAN CEMENT	589,511	41.55	24,494,182.05	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	1,075.00	19,948,775.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	31.40	10,928,079.20	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,430.00	12,870,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	289,000	44.00	12,716,000.00	
	CHINA AIRLINES LTD	183,000	26.65	4,876,950.00	
	EVA AIRWAYS CORP	162,000	34.15	5,532,300.00	
	EVERGREEN MARINE	308,039	140.00	43,125,460.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	27.95	13,192,400.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	64,900	155.00	10,059,500.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	126.50	27,450,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	35.75	6,329,930.75	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	508.00	10,127,996.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	199.00	14,019,152.00	
	GIANT MANUFACTURING	34,464	256.00	8,822,784.00	

NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	331.00	10,261,000.00
POU CHEN	273,780	31.75	8,692,515.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	42,000	613.00	25,746,000.00
MOMO.COM INC	5,000	882.00	4,410,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	265.00	23,464,160.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	645,395	64.90	41,886,135.50
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	587,664	18.05	10,607,335.20
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,011,237	25.85	51,990,476.45
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,397,452	29.15	40,735,725.80
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,248,238	26.40	32,953,483.20
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,059,344	23.45	24,841,616.80
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,211,339	37.15	45,001,243.85
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	17.40	20,129,868.60
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,284,432	17.35	22,284,895.20
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,078,434	27.30	29,441,248.20
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	451,861	52.20	23,587,144.20
CHAILEASE HOLDING CO LTD	144,167	228.50	32,942,159.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,349,159	23.40	31,570,320.60
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	54.80	48,669,140.40
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,896,226	16.00	30,339,616.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	909,435	63.40	57,658,179.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,262,866	9.61	12,136,142.26
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	206,724	78.40	16,207,161.60
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	234.00	11,232,000.00
ACER INC	255,803	28.40	7,264,805.20
ADVANTECH CO LTD	43,336	353.00	15,297,608.00
ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	333.00	24,006,636.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	18.05	17,058,874.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	173.00	20,535,100.00
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,049,000	14.20	14,895,800.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	23.00	9,930,480.00
DELTA ELECTRONICS INC	217,903	235.00	51,207,205.00
E INK HOLDINGS INC	94,000	212.00	19,928,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,447,248	115.50	167,157,144.00
INVENTEC CO LTD	280,511	25.75	7,223,158.25
LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	1,835.00	20,258,400.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	63.10	14,226,021.20
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	135.50	8,130,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	372.00	7,812,000.00
PEGATRON CORP	200,474	69.40	13,912,895.60
QUANTA COMPUTER INC	286,270	80.60	23,073,362.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	61.50	12,429,150.00



	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	141,000	206.50	29,116,500.00	
	WIWYNN CORP	8,000	900.00	7,200,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	260,692	57.10	14,885,513.20	
	YAGEO CORPORATION	54,764	405.00	22,179,420.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	118.00	16,274,796.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	505,315	126.00	63,669,690.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	81.20	17,539,200.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	107.50	26,359,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	359,315	105.00	37,728,075.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,435.00	4,305,000.00	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,460.00	8,760,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	625.00	15,000,000.00	
	MEDIATEK INC	179,804	924.00	166,138,896.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	65.70	7,555,500.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	74,045	398.50	29,506,932.50	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,530.00	12,240,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	301,000	56.10	16,886,100.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	450.00	27,874,800.00	
	SILERGY CORP	9,000	2,790.00	25,110,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,940,389	541.00	1,590,750,449.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,411,000	51.80	73,089,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	102.00	9,078,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	225.00	7,200,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	28.50	9,946,500.00	
	新台湾ドル 小計	39,083,737		3,784,177,018.71 (17,190,002,525)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	332.85	32,027,159.85	
	COAL INDIA LTD	180,326	198.75	35,839,792.50	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	238.60	14,178,805.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	118.30	22,922,399.50	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	165.55	41,835,974.95	
	PETRONET LNG LTD	83,779	224.60	18,816,763.40	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	360,062	2,798.75	1,007,723,522.50	
	ACC LTD	5,315	2,138.10	11,364,001.50	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	365.30	26,861,604.90	
	ASIAN PAINTS LTD	42,204	2,686.80	113,393,707.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	581.10	17,112,813.90	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,309.10	41,274,613.90	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	399.75	72,155,274.75	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	369.55	25,784,981.70	
	JSW STEEL LTD	99,332	572.20	56,837,770.40	
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	2,590.80	33,154,467.60	

PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,096.55	38,155,113.45
SHREE CEMENT LTD	1,387	19,198.00	26,627,626.00
SRF LTD	14,609	2,298.50	33,578,786.50
TATA STEEL LTD	94,085	1,044.85	98,304,712.25
ULTRATECH CEMENT LTD	11,556	5,481.90	63,348,836.40
UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	747.30	52,050,192.30
VEDANTA LTD	107,173	302.90	32,462,701.70
ADANI ENTERPRISES LTD	34,272	2,219.20	76,056,422.40
BHARAT ELECTRONICS LTD	169,135	245.55	41,531,099.25
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,132.05	40,375,695.30
LARSEN & TOUBRO LTD	82,638	1,595.10	131,815,873.80
SIEMENS INDIA LTD	11,025	2,368.75	26,115,468.75
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	649.50	14,933,953.50
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	64,743	735.50	47,618,476.50
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	656.55	17,369,030.25
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,793.55	14,994,078.00
BAJAJ AUTO LTD	9,644	3,878.65	37,405,700.60
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,220.75	19,611,443.25
BHARAT FORGE LTD	30,322	679.20	20,594,702.40
EICHER MOTORS LTD	14,685	2,716.00	39,884,460.00
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,598.10	31,795,547.80
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	101,669	1,045.10	106,254,271.90
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	15,707	7,929.85	124,554,153.95
MRF LTD	432	70,425.75	30,423,924.00
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	124,426	124.40	15,478,594.40
TATA MOTORS LTD	190,082	428.50	81,450,137.00
PAGE INDUSTRIES LTD	886	41,512.90	36,780,429.40
TITAN INDUSTRIES LTD	46,501	2,139.70	99,498,189.70
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	524.85	23,056,660.50
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	3,780.65	29,697,005.75
TRENT LTD	19,255	1,084.25	20,877,233.75
ZOMATO LTD	170,264	68.70	11,697,136.80
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	3,830.35	67,123,053.40
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,474	3,347.25	38,406,346.50
ITC LTD	345,135	270.85	93,479,814.75
MARICO LTD	81,711	496.65	40,581,768.15
NESTLE INDIA LIMITED	3,906	16,768.15	65,496,393.90
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	754.40	46,028,207.20
UNITED SPIRITS LTD	32,483	786.10	25,534,886.30
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,518.20	14,523,101.20
DABUR INDIA LTD	58,111	497.65	28,918,939.15
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	762.95	29,346,108.80

HINDUSTAN UNILEVER LTD	97,997	2,197.70	215,368,006.90
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	13,485	3,670.05	49,490,624.25
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	529.85	18,764,637.75
BIOCON LTD	58,256	337.15	19,641,010.40
CIPLA LTD	49,816	971.95	48,418,661.20
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	3,507.20	51,843,430.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,322.90	54,658,747.60
LUPIN LTD	26,552	618.40	16,419,756.80
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	110,469	858.85	94,876,300.65
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,110	2,889.10	17,652,401.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	613.35	18,482,688.90
AXIS BANK LTD	273,120	661.30	180,614,256.00
BANDHAN BANK LTD	74,811	333.80	24,971,911.80
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	205,038	2,265.45	464,503,337.10
ICICI BANK LTD	591,364	732.75	433,321,971.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	62,523	1,865.20	116,617,899.60
STATE BANK OF INDIA	226,932	466.95	105,965,897.40
YES BANK LTD	1,020,164	13.20	13,466,164.80
BAJAJ FINANCE LTD	32,202	5,898.55	189,945,107.10
BAJAJ FINSERV LTD	3,888	12,471.00	48,487,248.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	676.15	26,060,849.45
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,073.35	13,334,227.05
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	1,733.25	20,317,156.50
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	771.00	23,911,023.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,167.80	24,776,044.80
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	129,053	604.90	78,064,159.70
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,125.30	26,489,562.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	563.30	17,874,635.60
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,163.70	62,572,149.00
DLF LTD	56,420	324.85	18,328,037.00
GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,371.60	17,452,238.40
HCL TECHNOLOGIES LTD	123,161	1,028.65	126,689,562.65
INFOSYS LTD	396,083	1,515.00	600,065,745.00
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	4,370.70	25,157,749.20
MINDTREE LTD	6,247	3,114.60	19,456,906.20
MPHASIS LTD	7,796	2,592.85	20,213,858.60
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	106,835	3,427.10	366,134,228.50
TATA ELXSI LTD	4,179	8,693.60	36,330,554.40
TECH MAHINDRA LTD	72,109	1,138.60	82,103,307.40
WIPRO LTD	179,580	475.05	85,309,479.00
BHARTI AIRTEL LTD	294,891	676.35	199,449,527.85
INDUS TOWERS LTD	90,578	207.50	18,794,935.00

	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	1,812.65	77,182,637.00
	ADANI POWER LTD	85,623	287.75	24,638,018.25
	ADANI TOTAL GAS LTD	33,068	2,498.05	82,605,517.40
	ADANI TRANSMISSION LTD	32,827	2,116.50	69,478,345.50
	GAIL INDIA LTD	174,768	151.55	26,486,090.40
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	367.90	9,831,759.60
	NTPC LTD	664,141	155.15	103,041,476.15
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	327,337	224.85	73,601,724.45
	TATA POWER CO LTD	199,512	233.05	46,496,271.60
	インドルピー 小計	10,240,435		8,110,877,765.75 (14,112,927,312)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	106,599	18.22	1,942,233.78
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	3.93	1,846,038.90
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.76	1,227,008.70
	INDUSTRIES QATAR	196,788	18.16	3,573,670.08
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	7.33	1,496,470.64
	MASRAF AL RAYAN	732,376	4.82	3,530,052.32
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	11.47	1,130,471.73
	QATAR ISLAMIC BANK	185,298	23.12	4,284,089.76
	QATAR NATIONAL BANK	530,405	20.00	10,608,100.00
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.50	726,837.47
	OOREDOO QSC	72,800	7.84	571,261.60
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	18.51	1,786,437.12
	カタールリアル 小計	3,344,472		32,722,672.10 (1,201,903,746)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	211.86	4,771,087.20
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	245.67	3,603,978.90
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	8,411	1,512.23	12,719,366.53
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	51,324	256.56	13,167,685.44
	GOLD FIELDS LTD	97,102	142.93	13,878,788.86
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	48.68	2,740,732.68
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	114,090	183.67	20,954,910.30
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	577.30	3,101,255.60
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	54,913	169.02	9,281,395.26
	SASOL LTD	62,963	419.86	26,435,645.18
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	44.91	17,736,036.84
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	216.08	5,985,848.16
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	130.12	5,273,633.48
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	194.76	5,552,607.60
	NASPERS LTD-N SHS	25,573	1,836.03	46,952,795.19
	PEPKOR HOLDINGS LTD	144,533	20.56	2,971,598.48
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	138.53	5,202,355.62

	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	53.22	5,880,543.90	
	BID CORP LTD	35,017	321.30	11,250,962.10	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	278.72	9,872,819.84	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	60,003	210.34	12,621,031.02	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	142.27	3,311,191.98	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	141.53	7,951,438.46	
	ABSA GROUP LTD	95,814	163.80	15,694,333.20	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9,724	2,074.70	20,174,382.80	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	218.31	13,777,762.41	
	STANDARD BANK GROUP LTD	150,257	158.25	23,778,170.25	
	FIRSTRAND LTD	560,323	66.92	37,496,815.16	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	286.13	4,917,716.31	
	REMGRO LTD	55,441	140.40	7,783,916.40	
	DISCOVERY LIMITED	59,544	135.84	8,088,456.96	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	12.39	6,066,292.68	
	SANLAM LTD	214,053	59.11	12,652,672.83	
	NEPI ROCKCASTLE SA	60,556	92.27	5,587,502.12	
	MTN GROUP LTD	194,516	146.25	28,447,965.00	
	VODACOM GROUP	62,331	136.03	8,478,885.93	
	南アフリカランド 小計	3,539,853		444,162,580.67 (3,855,331,200)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	4.17	1,851,571.74	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	9.75	3,188,620.50	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	8.34	1,549,413.54	
	DUBAI ISLAMIC BANK	335,455	5.90	1,979,184.50	
	EMIRATES NBD PJSC	334,478	13.55	4,532,176.90	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	492,228	19.70	9,696,891.60	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	487,034	5.14	2,503,354.76	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	576,832	5.79	3,339,857.28	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	404,510	27.68	11,196,836.80	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	3,587,378		39,837,907.62 (1,458,067,418)	
クウェートディ ナール	AGILITY	187,098	1.12	211,233.64	
	BOUBYAN BANK K.S.C	152,875	0.80	122,758.62	
	GULF BANK	137,143	0.31	42,651.47	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	632,130	0.85	540,471.15	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	838,738	1.02	863,061.40	
	MABANEE CO KPSC	133,798	0.79	106,235.61	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.60	180,472.64	
	クウェートディナール 小計	2,378,612		2,066,884.53 (907,486,321)	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	34.83	696,600.00	

オフショア人民  
元

PETROCHINA CO LTD-A	100,000	5.80	580,000.00
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	20.87	2,007,694.00
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	16.20	1,289,520.00
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	17.04	1,496,112.00
YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	44.75	1,253,000.00
YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	42.68	2,612,016.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.07	833,001.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	35.57	1,047,180.80
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	6.65	257,355.00
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	59.14	1,218,284.00
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	78,847	15.93	1,256,032.71
CHINA JUSHI CO LTD -A	96,700	16.29	1,575,243.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	38.55	801,840.00
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	8,000	128.15	1,025,200.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	42.86	1,064,042.36
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	23.26	862,946.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	18.49	184,900.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	2.11	972,710.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.79	287,400.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	15.84	353,232.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	144.24	1,125,072.00
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	8.91	270,864.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	19.85	303,705.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	16.30	1,290,960.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	3.49	768,149.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	16.02	776,169.00
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	39,625	28.07	1,112,273.75
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	18.65	135,249.80
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	29.53	529,768.20
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.65	1,046,090.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	11,200	68.90	771,680.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	5.88	807,912.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	19.10	941,630.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	42.54	459,432.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	16.78	164,444.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.57	1,183,812.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	6.26	577,172.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	85.77	1,500,975.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	54.91	506,270.20
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	11,775	87.94	1,035,493.50
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	9.73	1,082,949.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	11,400	133.19	1,518,366.00

YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	230.76	946,116.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	78.70	583,167.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	10.48	247,328.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	105,600	10.28	1,085,568.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	39.83	454,062.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	40.55	628,525.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	29.35	246,540.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	13.70	876,800.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	19.21	1,060,680.15
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.45	1,477,595.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.46	1,151,514.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	17,700	431.35	7,634,895.00
CRRC CORP LTD-A	185,800	5.07	942,006.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	102,600	14.91	1,529,766.00
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	91.41	692,247.93
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	7.12	162,336.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	10,200	164.05	1,673,310.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	43.15	250,270.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	87.73	552,699.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	18,800	50.95	957,860.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	52.75	604,304.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	16.00	769,600.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.57	1,181,313.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	25.90	937,580.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	58,320	33.39	1,947,304.80
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	100.88	1,177,774.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	7.97	1,300,704.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	17.41	729,479.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	64.51	1,831,632.43
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	17,900	11.14	199,406.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	91.76	917,600.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	29.65	1,206,755.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	391.91	1,003,289.60
TBEA CO LTD-A	22,519	24.72	556,669.68
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	11.86	512,352.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	2,760	54.09	149,288.40
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	5,320	125.91	669,841.20
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	5.24	1,044,856.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	12.28	246,963.08
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	35.00	1,106,000.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	46.98	388,054.80
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	10.85	978,670.00

ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	5.96	477,396.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	4.78	385,268.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	50.00	550,000.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	9.69	250,971.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	338,800	4.64	1,572,032.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.69	187,600.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	6.74	1,081,770.00
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	51.81	1,051,743.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	48.91	260,152.29
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	6.14	272,616.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	21.49	1,196,993.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	17.30	377,832.00
BYD CO LTD -A	9,700	322.41	3,127,377.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	33,348	15.10	503,554.80
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	40.38	747,030.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	21.96	753,228.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	141.60	1,189,440.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	12.56	368,008.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	54.10	37,870.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	17.11	728,886.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	20.18	792,145.72
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	1,031	682.69	703,853.39
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	111.20	311,360.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	31.31	1,361,985.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	28.90	802,264.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	6,102	60.98	372,099.96
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	115.69	890,813.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	23.53	611,780.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	4.23	431,460.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	53.25	426,000.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	52.00	1,362,400.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	5.56	440,908.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	12.46	417,160.80
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	22.00	539,000.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	8.70	466,320.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.53	910,282.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	357.55	1,036,895.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	34.67	565,121.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	14.06	320,568.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	4.77	293,355.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	186.90	2,280,180.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	9.64	1,065,220.00



DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	15,480	32.33	500,468.40
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	45.55	461,877.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	4.25	172,125.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	41.68	445,976.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	223.30	357,280.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	54.35	119,570.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	60.74	1,111,542.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	139.28	417,840.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	8.15	484,925.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	23.15	238,445.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	53.87	538,700.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	126.50	999,350.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	31.76	146,096.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	20,248	78.75	1,594,530.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	17.84	488,816.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	60.05	1,020,850.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	27.37	32,844.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	37.03	1,270,203.06
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	47.15	815,695.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	164.55	1,497,405.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	5.70	157,890.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	167.42	937,552.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	27.75	319,125.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	46.54	325,780.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	8,500	1,853.00	15,750,500.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	215.40	2,110,920.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	51.79	1,737,968.82
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	14.49	388,332.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	283.37	2,658,010.60
TONGWEI CO LTD-A	31,600	50.83	1,606,228.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	18.77	716,263.20
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	176.01	3,731,412.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	44.95	453,995.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	17.67	93,651.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	19.54	580,338.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	54,323	36.66	1,991,481.18
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	6,500	42.88	278,720.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	33,700	26.61	896,757.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	75.03	212,935.14
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	40.85	397,062.00
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	7,875	28.42	223,807.50
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	46.33	572,175.50

JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	65,300	24.06	1,571,118.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	11.88	123,552.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	17.22	254,856.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	4.93	122,461.20
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	43.66	314,744.94
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	304.76	2,559,984.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	144.53	289,060.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	8.44	319,285.20
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	271.79	54,358.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	23,400	22.96	537,264.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	7,491	129.10	967,088.10
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	49.29	793,569.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	65.50	360,250.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	169.90	373,780.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	41.65	424,830.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	88.05	871,695.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	31.82	706,181.26
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	30.68	490,880.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	95.70	765,600.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	19.28	363,428.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	529.10	1,100,528.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	30.95	1,179,256.90
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	7,940	117.79	935,252.60
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	21,294	27.99	596,019.06
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	5.58	357,678.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	38.96	423,884.80
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	25.52	178,640.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	9,440	22.15	209,096.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	18.31	205,657.92
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	45.10	766,700.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	102.62	1,689,535.68
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	56.11	557,733.40
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	312.75	1,219,725.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	18.14	163,622.80
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	21.89	762,822.72
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	45.30	439,410.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	3.00	1,060,800.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.48	259,840.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	113,400	17.03	1,931,202.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.94	488,566.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	13.81	1,556,387.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	6.65	1,527,771.00

BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	11.46	1,690,350.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	34.34	2,002,022.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.46	293,930.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	5.97	745,653.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.14	404,746.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	137,700	40.29	5,547,933.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.84	1,050,624.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	3.29	1,015,294.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.07	605,358.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.66	1,217,192.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	20.19	1,922,088.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	14.35	1,713,390.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.24	741,460.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	7.95	1,099,485.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.44	421,400.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	12.87	1,021,878.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.42	425,388.60
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.80	115,420.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.76	409,092.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.96	400,093.60
CITIC SECURITIES CO-A	49,680	20.23	1,005,026.40
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	23.35	562,735.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	97,856	23.85	2,333,865.60
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	14.26	51,336.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.90	355,180.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	6.44	533,232.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	17.94	1,087,164.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	127,170	7.99	1,016,088.30
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.75	1,066,425.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.01	913,820.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	88.90	480,060.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	13.81	435,015.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	6.75	593,325.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	7.84	334,768.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	9.59	389,123.84
SDIC CAPITAL CO LTD-A	69,616	6.41	446,238.56
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.11	851,592.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.85	438,900.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	94,600	3.17	299,882.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.43	455,791.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	21.56	392,392.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	44.62	2,980,616.00

CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	12.54	685,938.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	17.83	957,471.00
GEMDALE CORP-A	45,500	11.86	539,630.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	123,480	3.83	472,928.40
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	15.58	1,274,444.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	24.63	315,264.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	12.01	102,085.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	8.31	223,539.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	209.17	1,008,826.91
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	26,460	15.12	400,075.20
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	9.85	283,680.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.02	335,314.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	12,740	41.39	527,308.60
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	37.50	405,000.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	13.89	461,148.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	100.76	302,280.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	6,110	53.72	328,229.20
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	115.10	633,050.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	19.28	253,917.60
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	28.70	1,087,730.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.68	421,728.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	29.38	822,640.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	10.71	372,708.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	122.79	1,117,389.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	14.01	291,408.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	9.33	420,783.00
GOERTEK INC -A	26,900	38.31	1,030,539.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	4.54	227,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	74.91	524,370.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	24.98	492,405.76
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	10.06	169,008.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	33.62	1,561,649.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,080	198.09	213,937.20
NINESTAR CORP-A	18,543	47.55	881,719.65
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	5.52	172,776.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	16.19	393,417.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	93.20	443,632.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	100.17	644,593.95
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	18.34	522,690.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.27	435,690.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	17.69	324,434.60
WESTONE INFORMATION INDUST-A	20,100	34.95	702,495.00

	WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	65.50	275,100.00
	WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	41,316	11.80	487,528.80
	XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	176.61	830,067.00
	YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	77.64	873,450.00
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	15.72	476,316.00
	ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	32.68	284,316.00
	ZTE CORP-A	12,600	24.25	305,550.00
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	6.99	1,214,862.00
	CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	6.26	1,510,538.00
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	23.71	4,264,954.80
	ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	18.43	1,024,708.00
	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	3.76	1,187,032.00
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	10.17	687,492.00
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	11.84	1,092,832.00
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	122.63	870,305.11
	AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	103.98	1,054,149.24
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	3.19	263,175.00
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	6,272	136.69	857,319.68
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	15,120	76.34	1,154,260.80
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	46.20	346,500.00
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	89.90	674,250.00
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	17,450	98.98	1,727,201.00
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	24.08	717,584.00
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	47,040	60.98	2,868,499.20
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	68.68	1,446,057.40
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	267.35	828,785.00
	SG MICRO CORP-A	2,100	274.91	577,311.00
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	56.49	146,874.00
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	344.88	965,664.00
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	29,500	45.12	1,331,040.00
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	8.75	286,562.50
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	13.91	312,502.06
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	62.79	1,595,996.22
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	184.00	901,600.00
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,400	163.93	885,222.00
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	68.49	972,558.00
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	57.80	983,871.60
	オフショア人民元 小計	16,920,463		291,378,240.21 (5,839,744,414)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	20.80	490,027.20
	SAUDI ARABIAN OIL CO	288,739	40.40	11,665,055.60
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	56.50	665,287.50

NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	19.02	607,270.56	
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	28,237	153.40	4,331,555.80	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	53.10	1,714,227.30	
SAUDI ARABIAN MINING CO	95,014	61.00	5,795,854.00	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	106,249	113.00	12,006,137.00	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,414	30.05	1,154,340.70	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	16.84	1,741,778.04	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	56.30	1,495,102.80	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	240.00	1,009,680.00	
JARIR MARKETING CO	12,500	156.80	1,960,000.00	
ALMARAI CO	30,130	53.80	1,620,994.00	
SAVOLA	25,336	37.95	961,501.20	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	201.80	2,364,490.60	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	210.80	1,678,389.60	
AL RAJHI BANK	227,653	94.20	21,444,912.60	
ALINMA BANK	109,956	36.00	3,958,416.00	
ARAB NATIONAL BANK	86,031	31.50	2,709,976.50	
BANK AL-JAZIRA	35,813	27.05	968,741.65	
BANK ALBILAD	61,145	48.70	2,977,761.50	
BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	51.20	3,457,843.20	
RIYAD BANK	166,012	36.70	6,092,640.40	
SAUDI BRITISH BANK	94,400	41.40	3,908,160.00	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	41,945	20.60	864,067.00	
THE SAUDI NATIONAL BANK	252,104	71.40	18,000,225.60	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	3,929	214.40	842,377.60	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	163.00	988,269.00	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	13.90	1,403,774.90	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	11.06	510,828.22	
ELM CO	2,436	281.00	684,516.00	
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	37.90	1,304,290.60	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	13.10	1,185,654.80	
SAUDI TELECOM CO	66,310	100.40	6,657,524.00	
ACWA POWER CO	9,184	150.00	1,377,600.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	24.44	2,253,881.24	
サウジアラビアリアル 小計	2,472,875		132,853,152.71 (4,762,785,524)	
合計	1,062,302,318		110,066,506,884 (110,066,506,884)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	6,452,032.00	
	メキシコペソ 小計		58,400	6,452,032.00	(44,038,989)
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	3,053,430.00	
		BANCO INTER SA-UNITS	31,500	348,390.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,446,768.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,608,200.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,407,634.00	
ブラジルリアル 小計		310,900	7,864,422.00	(215,069,921)	
投資信託受益証券合計			369,300	259,108,910	(259,108,910)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	8,041,601.00	
		OPERADORA DE SITES MEX-A-1	74,800	1,867,008.00	
	メキシコペソ 小計		466,500	9,908,609.00	(67,632,201)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	6,405,447.54	
	南アフリカランド 小計		478,733	6,405,447.54	(55,599,284)
投資証券合計			945,233	123,231,485	(123,231,485)
合計				382,340,395	(382,340,395)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 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 48銘柄	100.0%			2.8%
メキシコペソ	株式 19銘柄	95.0%			1.9%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.0%		0.0%
	投資証券 2銘柄			3.1%	0.1%
ブラジルリアル	株式 44銘柄	96.2%			5.0%
	投資信託受 益証券 5銘柄		3.8%		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	7銘柄	100.0%			0.2%
トルコリラ	株式	10銘柄	100.0%			0.2%
チェココルナ	株式	1銘柄	100.0%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%			0.1%
ポーランドズロチ	株式	15銘柄	100.0%			0.5%
ロシアルーブル	株式	3銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式	198銘柄	100.0%			25.2%
マレーシアリングgit	株式	34銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%			1.9%
フィリピンペソ	株式	20銘柄	100.0%			0.8%
インドネシアルピア	株式	25銘柄	100.0%			1.9%
韓国ウォン	株式	112銘柄	100.0%			12.3%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%			15.6%
インドルピー	株式	109銘柄	100.0%			12.8%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			1.1%
南アフリカランド	株式	36銘柄	98.6%			3.5%
	投資証券	1銘柄			1.4%	0.1%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	9銘柄	100.0%			1.3%
クウェートディナール	株式	7銘柄	100.0%			0.8%
オフショア人民元	株式	332銘柄	100.0%			5.3%
サウジアラビアリアル	株式	37銘柄	100.0%			4.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	



	2022年 6月10日現在
項目	金額（円）
預金	1,401,301,350
コール・ローン	280,345,948
国債証券	81,075,403,303
未収利息	1,363,968,432
前払費用	132,272,417
流動資産合計	84,253,291,450
資産合計	84,253,291,450
負債の部	
流動負債	
前受収益	153,076
未払金	39,990,563
未払解約金	47,073,707
未払利息	320
流動負債合計	87,217,666
負債合計	87,217,666
純資産の部	
元本等	
元本	46,386,185,089
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	37,779,888,695
元本等合計	84,166,073,784
純資産合計	84,166,073,784
負債純資産合計	84,253,291,450

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 6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>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2022年 6月10日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	46,386,185,089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 1.8145円 (1万口当たり純資産額) (18,145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 6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 6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

	2022年 6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>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> <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 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 6月11日
期首元本額	40,073,966,944円
期中追加設定元本額	11,294,119,317円
期中一部解約元本額	4,981,901,172円
期末元本額	46,386,185,089円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	5,266,416,470円
世界経済インデックスファンド	12,199,794,278円
DC 新興国債券インデックス・オープン	5,055,242,790円
DC 世界経済インデックスファンド	10,862,872,552円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	4,012,528円
コア投資戦略ファンド（安定型）	104,373,835円
コア投資戦略ファンド（成長型）	273,391,462円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	56,124,342円

区分	2022年 6月10日現在
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	456,944,224円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,412,835,985円
コア投資戦略ファンド（切替型）	107,708,778円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	207,451,825円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	96,621,173円
SMT インデックスバランス・オープン	168,654,966円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,066,654,802円
SMT 世界経済インデックス・オープン	331,919,525円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	411,822,973円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	659,489,046円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,186,130円
グローバル経済コア	736,860,579円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	37,677,189円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	5,548,851円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	23,290,675円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	17,866,193円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	7,223,997円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	7,940,476円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	284,944円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	73,496,653円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	463,749,377円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	103,873,706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）	17,465,408円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	292,262,934円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	286,165,422円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	284,706,302円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	283,079,813円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	278,676,104円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 6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	5,417,075,473
合計	5,417,075,473

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	34,495,368.00		
		MBONO 10% 12/05/24	104,250,000.00	105,963,870.00		
		MBONO 5.75% 03/05/26	198,300,000.00	176,863,770.00		
		MBONO 6.75% 03/09/23	61,600,000.00	60,632,264.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000.00	106,983,300.00		
		MBONO 7.75% 05/29/31	128,600,000.00	119,192,910.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	74,074,390.00		
		MBONO 7.75% 11/23/34	34,600,000.00	31,517,140.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	115,100,000.00	112,171,856.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	94,313,935.00		
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	125,141,208.00		
		MBONO 8% 11/07/47	93,100,000.00	83,101,060.00		
		MBONO 8% 12/07/23	88,000,000.00	86,485,520.00		
		メキシコペソ 小計			1,280,550,000.00	1,210,936,591.00 (8,265,368,795)
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000.00	76,121,165.76		
		BLTN 0% 07/01/23	55,000,000.00	48,191,060.49		
		BLTN 0% 07/01/24	30,850,000.00	24,073,131.14		
		BLTN 0% 07/01/25	11,900,000.00	8,290,150.47		
		BNTNF 10% 01/01/23	40,100,000.00	39,405,962.35		
		BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	30,065,746.55		
		BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000.00	37,621,958.30		
		BNTNF 10% 01/01/29	21,700,000.00	19,223,012.87		
		BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	11,976,426.40		
		BNTNF 10% 01/01/33	600,000.00	508,798.15		
BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,288,875.00				
BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,786,000.00				
			342,400,000.00	298,552,287.48		

ブラジルリアル 小計			(8,164,569,116)
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	805,000,000.00	632,600,428.00
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,685,000,000.00	2,429,904,035.52
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,820,000,000.00	1,710,650,659.90
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,940,000,000.00	1,737,550,370.74
	BTPCL 4% 03/01/23	1,010,000,000.00	976,540,222.07
	BTPCL 5% 03/01/35	2,040,000,000.00	1,789,496,943.36
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	609,398,432.94
	BTPCL 6% 01/01/43	1,730,000,000.00	1,644,016,629.90
チリペソ 小計		12,690,000,000.00	11,530,157,722.43 (1,875,679,937)
コロンビア ペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	64,227,121,000.00
	COLTES 6.25% 11/26/25	4,400,000,000.00	3,895,584,000.00
	COLTES 7.25% 10/18/34	37,600,000,000.00	27,208,488,000.00
	COLTES 7.25% 10/26/50	14,900,000,000.00	9,293,279,000.00
コロンビアペソ 小計		122,200,000,000.00	104,624,472,000.00 (3,653,277,313)
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,350,160.00
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	5,111,051.50
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,690,343.00
	PERUGB 5.94% 02/12/29	8,200,000.00	7,546,132.00
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,800,000.00	6,897,852.00
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,350,000.00	7,927,239.50
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,450,000.00	6,721,390.00
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,650,000.00	7,263,063.00
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,050,000.00	6,377,849.50
	ペルーソル 小計		60,050,000.00
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	21,670,750.00
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	15,507,400.00
ウルグアイペソ 小計		42,000,000.00	37,178,150.00 (126,744,031)
ドミニカペ ソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,581,152.00
	DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	32,685,510.00
ドミニカペソ 小計		53,400,000.00	53,266,662.00 (129,837,488)
チェココ ルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	17,892,855.00
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	54,810,552.00
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	43,557,250.00
	CZGB 0.95% 05/15/30	64,900,000.00	47,192,035.00
	CZGB 0% 12/12/24	12,000,000.00	10,428,480.00
	CZGB 1.2% 03/13/31	57,000,000.00	41,158,560.00
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	52,075,530.00

	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	12,877,710.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	47,000,000.00	34,644,640.00	
	CZGB 1% 06/26/26	54,800,000.00	46,127,900.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	62,700,000.00	56,964,204.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	63,300,000.00	54,244,302.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	58,500,000.00	50,074,245.00	
	CZGB 2% 10/13/33	64,500,000.00	46,909,560.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	30,628,065.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	44,932,868.00	
	チェココルナ 小計	787,900,000.00	644,518,756.00 (3,722,031,364)	
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	492,362,145.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	222,500,000.00	208,965,325.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	406,666,520.00	
	HGB 1% 11/26/25	635,000,000.00	517,150,350.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	542,000,000.00	339,958,660.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	153,533,440.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	494,761,800.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	387,268,550.00	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	288,539,940.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	594,213,480.00	
	HGB 3% 04/25/41	321,000,000.00	181,509,450.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	372,356,775.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	410,161,650.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	479,016,800.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	225,659,200.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	629,633,400.00	
HGB 6.0% 11/24/23	396,000,000.00	390,606,480.00		
HGB 6.75% 10/22/28	382,000,000.00	368,656,740.00		
	ハンガリーフォリント 小計	8,702,000,000.00	6,941,020,705.00 (2,504,223,096)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	13,884,435.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	12,111,671.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	15,200,000.00	9,914,352.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	8,400,000.00	5,369,448.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	16,225,723.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	16,500,000.00	16,158,615.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	15,350,000.00	14,208,881.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	20,223,997.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	14,175,040.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	17,600,000.00	14,094,608.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	19,990,512.00	

	POLGB 3.25% 07/25/25	20,350,000.00	18,255,171.00	
	POLGB 3.75% 05/25/27	4,800,000.00	4,135,920.00	
	POLGB 4% 10/25/23	12,700,000.00	12,282,043.00	
ポーランドズロチ 小計		229,450,000.00	191,030,416.00	(5,916,173,777)
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,266,950.00	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	1,200,000.00	1,103,184.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	3,300,000.00	2,754,015.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	12,600,000.00	11,096,316.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	6,000,000.00	4,233,900.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,049,900.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	10,500,000.00	8,576,295.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	5,400,000.00	4,057,452.00	
	ROMGB 4.25% 06/28/23	11,800,000.00	11,423,344.00	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,058,606.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	3,200,000.00	2,946,688.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	3,800,000.00	2,747,058.00	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,191,413.00	
	ROMGB 4% 10/25/23	13,800,000.00	13,100,202.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	3,000,000.00	2,696,280.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,002,080.00	
ルーマニアレイ 小計		100,500,000.00	87,303,683.00	(2,518,492,995)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	12,200,000.00	10,804,442.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,169,621.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	17,600,000.00	17,721,088.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	5,950,000.00	5,859,560.00	
	MGS 3.582% 07/15/32	3,500,000.00	3,330,425.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	25,500,000.00	25,153,200.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,896,463.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	18,350,000.00	16,264,155.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,185,413.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	7,692,092.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,600,000.00	1,617,632.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	29,800,000.00	29,349,126.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	20,800,000.00	20,834,320.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	14,450,000.00	14,552,595.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	8,761,248.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	26,301,600.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000.00	19,885,087.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	13,950,000.00	12,166,353.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,251,970.00	
MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	19,519,276.50		



	MGS 4.504% 04/30/29	3,200,000.00	3,275,808.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	9,550,000.00	9,739,854.00	
マレーシアリングット 小計		285,150,000.00	279,331,329.50	(8,523,013,391)
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	88,963,310.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	116,700,000.00	113,320,368.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000.00	182,531,680.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	56,800,000.00	46,557,256.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	53,964,645.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	111,100,000.00	102,584,185.00	
	THAIGB 1% 06/17/27	134,000,000.00	124,851,820.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	113,600,000.00	112,559,424.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	123,000,000.00	124,990,140.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	90,100,000.00	76,111,074.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	93,200,000.00	94,441,424.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	61,161,018.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	122,700,000.00	121,149,072.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	129,813,700.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	99,000,000.00	101,644,290.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000.00	187,009,290.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	193,849,200.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	111,623,870.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	135,914,520.00	
タイバーツ 小計		2,188,000,000.00	2,163,040,286.00	(8,392,596,309)
フィリピン ペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	29,694,300.00	
フィリピンペソ 小計		30,000,000.00	29,694,300.00	(75,248,325)
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,853,586,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	18,612,828,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	26,000,000,000.00	24,788,920,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	36,500,000,000.00	36,264,575,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	50,300,000,000.00	51,137,998,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	34,000,000,000.00	32,989,860,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	16,235,914,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	41,000,000,000.00	38,746,640,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	59,930,625,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	26,300,000,000.00	26,874,655,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,151,600,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	28,300,000,000.00	27,729,755,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	34,931,260,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	21,000,000,000.00	21,195,930,000.00	

	INDOGB 7.5% 06/15/35	34,700,000,000.00	35,131,668,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	18,761,008,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	40,800,000,000.00	42,099,480,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	43,000,000,000.00	42,628,910,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	45,600,000,000.00	48,229,752,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,200,000,000.00	33,425,184,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	33,838,698,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,262,558,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	53,600,000,000.00	56,766,152,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	47,236,640,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	22,913,808,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	43,534,966,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	26,072,844,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,074,432,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,918,131,000.00	
	インドネシアルピア 小計	902,800,000,000.00	927,338,377,000.00 (8,624,246,906)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	155,400,000.00	166,977,300.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	54,800,000.00	36,979,040.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	46,100,000.00	29,377,225.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	32,000,000.00	32,477,120.00	
	SAGB 7% 02/28/31	64,700,000.00	52,661,271.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	100,000,000.00	86,816,000.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000.00	80,089,575.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	86,000,000.00	69,146,580.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	143,200,000.00	114,528,496.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	90,000,000.00	78,159,600.00	
	SAGB 8% 01/31/30	140,700,000.00	126,224,784.00	
	SAGB 9% 01/31/40	74,300,000.00	62,290,148.00	
		南アフリカランド 小計	1,084,900,000.00	935,727,139.00 (8,122,111,566)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,446,048.00	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	2,993,910.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	8,000,000.00	8,027,360.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,007,071.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,056,300.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,200,000.00	7,175,592.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,024,360.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,827,062.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,602,400.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	17,080,661.00	
	CGB 2.89% 11/18/31	5,000,000.00	5,026,050.00	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,058,920.00	

	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,353,970.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	15,000,000.00	15,250,950.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,626,055.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	12,900,000.00	13,138,392.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	17,500,000.00	17,830,925.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,486,800.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	15,300,000.00	15,653,124.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,536,692.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,309,120.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,612,260.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	14,900,000.00	15,396,319.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,793,980.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	15,200,000.00	15,705,704.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,721,566.00	
	CGB 3.29% 10/18/23	10,000,000.00	10,164,400.00	
	CGB 3.53% 10/18/51	5,100,000.00	5,306,244.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,300,000.00	7,818,154.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	17,500,000.00	19,009,200.00	
	オフショア人民元 小計	415,600,000.00	424,039,589.00 (8,498,516,634)	
	合計		81,075,403,303 (81,075,403,303)	

## 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 13銘柄	100.0%	10.2%
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 8銘柄	100.0%	2.3%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	4.5%
ペルーソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.4%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
チェココルナ	国債証券 16銘柄	100.0%	4.6%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	3.1%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	7.3%
ルーマニアレイ	国債証券 16銘柄	100.0%	3.1%

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

**【中間財務諸表】**

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3及び第57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、中間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6期中間計算期間(2022年6月11日から2022年12月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けておりません。

## 【SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 （2022年 6月10日現在）	第6期中間計算期間 （2022年12月10日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	45,846,847	60,041,966
親投資信託受益証券	3,990,341,136	4,655,316,752
未収入金	16,225,362	1,474,373
流動資産合計	4,052,413,345	4,716,833,091
資産合計	4,052,413,345	4,716,833,091
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	13,306,904	3,546,836
未払受託者報酬	998,505	1,186,804
未払委託者報酬	7,987,983	9,494,341
未払利息	52	336
その他未払費用	99,786	118,610
流動負債合計	22,393,230	14,346,927
負債合計	22,393,230	14,346,927
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,277,920,253	3,839,662,901
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	752,099,862	862,823,263
（分配準備積立金）	327,696,873	314,104,635
元本等合計	4,030,020,115	4,702,486,164
純資産合計	4,030,020,115	4,702,486,164
負債純資産合計	4,052,413,345	4,716,833,091

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2021年 6月11日 至 2021年12月10日	第6期中間計算期間 自 2022年 6月11日 至 2022年12月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	106	75
有価証券売買等損益	426,736	1,002,253
営業収益合計	426,630	1,002,328
<b>営業費用</b>		
支払利息	7,788	12,805
受託者報酬	787,687	1,186,804
委託者報酬	6,301,432	9,494,341
その他費用	78,701	118,610
営業費用合計	7,175,608	10,812,560
営業利益又は営業損失（ ）	7,602,238	9,810,232
経常利益又は経常損失（ ）	7,602,238	9,810,232
中間純利益又は中間純損失（ ）	7,602,238	9,810,232
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,995	212,040
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	402,352,831	752,099,862
剰余金増加額又は欠損金減少額	169,202,473	154,498,947
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	169,202,473	154,498,947
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,350,613	34,177,354
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,350,613	34,177,354
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	546,599,458	862,823,263

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 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。
-----------------	---------------------------------------

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第5期 (2022年 6月10日現在)	第6期中間計算期間 (2022年12月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,277,920,253口	3,839,662,901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) 1.2294円 (12,294円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2247円 (12,247円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第6期中間計算期間 (2022年12月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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。



## （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5期 自 2021年 6月11日 至 2022年 6月10日	第6期中間計算期間 自 2022年 6月11日 至 2022年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,985,054,995円	3,277,920,253円
期中追加設定元本額	1,555,340,467円	712,341,149円
期中一部解約元本額	262,475,209円	150,598,501円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （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、中間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12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,688,670,332
株式	507,905,479,090
派生商品評価勘定	10,458,750
未収入金	3,223,200
未収配当金	413,883,915
差入委託証拠金	130,884,200
流動資産合計	511,152,599,487
資産合計	511,152,599,487
負債の部	
流動負債	

項目	2022年12月10日現在
	金額（円）
前受金	10,460,400
未払金	1,085,470,525
未払解約金	97,618,792
未払利息	7,551
流動負債合計	1,193,557,268
負債合計	1,193,557,268
純資産の部	
元本等	
元本	259,949,870,211
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	250,009,172,008
元本等合計	509,959,042,219
純資産合計	509,959,042,219
負債純資産合計	511,152,599,487

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2022年12月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		259,949,870,211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)	1.9618円 (19,618円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2022年12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。

## （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12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2022年 6月11日

区分	2022年12月10日現在
期首元本額	262,569,150,387円
期中追加設定元本額	10,514,160,906円
期中一部解約元本額	13,133,441,082円
期末元本額	259,949,870,211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）	390,105,892円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,073,076,851円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,518,982円
SMT TOPIXインデックス・オープン	12,019,325,755円
世界経済インデックスファンド	4,406,804,298円
日本株式インデックス・オープン	3,242,802,104円
DCマイセレクション25	6,145,727,757円
DCマイセレクション50	18,999,999,302円
DCマイセレクション75	19,345,895,873円
DC日本株式インデックス・オープン	6,228,600,160円
DCマイセレクションS25	3,218,105,959円
DCマイセレクションS50	9,499,794,946円
DCマイセレクションS75	7,380,260,896円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,620,802,310円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	160,080,061円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	689,820,311円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	516,036,741円
DC世界経済インデックスファンド	3,836,893,720円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,388,022,271円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,247,114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
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	170,610,507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）	22,360,893円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	63,497,980円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	793,998,790円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	415,048,743円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,683,756,702円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	38,605,215円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	16,014,252円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	448,905,066円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	248,428,576円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	329,305,711円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	34,095,150円

区分	2022年12月10日現在
F O F s用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	565,870,767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	1,995,424,217円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,723,583,109円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,756,334,500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
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	528,070,232円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	449,645,240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）	224,057,987円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,933,180円
S M T インデックスバランス・オープン	57,872,922円
国内株式S M T Bセレクション（S M A専用）	27,448,014,961円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	452,804,007円
S M T 世界経済インデックス・オープン	54,265,060円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	204,555,847円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	37,111,181円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	9,957,860円
グローバル経済コア	221,784,339円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	30,441,864円
M y S M T T O P I Xインデックス（ノーロード）	372,158,365円
D Cターゲット・イヤーフンド2055	25,555,952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）	233,870,703円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	21,049,389円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	18,407,984円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	7,304,750円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	9,266,380円
10資産分散投資ファンド	32,436円
F O F s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）	44,215,746,561円
F O F s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）	768,141,857円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	338,098,144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）	25,768,337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）	348,761,100円
S M T A M日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	45,676,227,605円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	19,040,363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）	212,936,846円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年12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	1,849,639,600	-	1,860,100,000	10,460,400
合計		1,849,639,600	-	1,860,100,000	10,460,400

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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12月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	380,086,887
国債証券	527,185,821,890
地方債証券	32,195,233,196
特殊債券	36,125,183,775
社債券	28,158,917,000
未収入金	265,912,900
未収利息	1,325,349,994
前払費用	43,323,429
流動資産合計	625,679,829,071
資産合計	625,679,829,071
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	214,441,228
未払利息	1,067
流動負債合計	314,442,295
負債合計	314,442,295
純資産の部	
元本等	
元本	460,444,544,889
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	164,920,841,887
元本等合計	625,365,386,776
純資産合計	625,365,386,776
負債純資産合計	625,679,829,071

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年12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12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	460,444,544,889口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 99,816,000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 1.3582円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,582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）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2022年12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</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(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</p>

	2022年12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>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （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12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月11日
期首元本額	452,471,725,809円
期中追加設定元本額	20,799,597,696円
期中一部解約元本額	12,826,778,616円
期末元本額	460,444,544,889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）	4,193,484,847円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,977,837円
S M T 国内債券インデックス・オープン	21,151,067,728円
世界経済インデックスファンド	4,336,590,730円
D C マイセレクション 2 5	26,426,561,574円
D C マイセレクション 5 0	30,494,411,411円
D C マイセレクション 7 5	9,115,674,680円
D C 日本債券インデックス・オープン	433,624,049円
D C 日本債券インデックス・オープン S	91,650,277,967円
D C 日本債券インデックス・オープン P	66,758,866,868円
D C マイセレクション S 2 5	13,698,367,774円
D C マイセレクション S 5 0	15,332,110,683円
D C マイセレクション S 7 5	3,508,284,533円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	681,869,332円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,355,396,825円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	896,012,216円



区分	2022年12月10日現在
D C世界経済インデックスファンド	3,616,290,099円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	1,379,693円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	28,912,078円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	7,397,367円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	979,351円
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)	31,656,111円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	26,210,126円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,599,751,758円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	731,448,974円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,045,605,272円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	68,284,444円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	51,965,336円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	947,228,497円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,054,406,662円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,381,005,073円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	135,117,471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	16,949,687,320円
分散投資コア戦略ファンドA	19,987,138,934円
分散投資コア戦略ファンドS	25,033,949,794円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	182,590,884円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,483,249,804円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	73,624,064円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	37,152,804円
SMT インデックスバランス・オープン	61,201,075円
SMT 世界経済インデックス・オープン	43,712,315円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	84,958,595円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	137,117,815円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,472,959円
グローバル経済コア	233,700,313円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	35,743,273円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	21,438,295円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	38,972,149円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	21,850,802円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	5,686,064円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	4,202,953円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	53,418,951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)	84,939,186,696円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	46,558,429円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	17,605,108円

区分	2022年12月10日現在
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	395,604,208円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年12月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
預金	8,797,648,673
コール・ローン	895,694,546
株式	531,141,733,309
投資信託受益証券	229,232,017
投資証券	12,143,620,580
派生商品評価勘定	525,539,307
未収入金	281,597
未収配当金	808,461,132
差入委託証拠金	3,578,152,226
流動資産合計	558,120,363,387
<b>資産合計</b>	<b>558,120,363,387</b>
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	91,952,148
前受金	431,631,423
未払金	22,654,575
未払解約金	130,768,032
未払利息	2,515
流動負債合計	677,008,693
<b>負債合計</b>	<b>677,008,693</b>
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	128,212,440,528
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	429,230,914,166
元本等合計	557,443,354,694
<b>純資産合計</b>	<b>557,443,354,694</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>558,120,363,387</b>

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年12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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <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>

	2022年12月10日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	2022年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	128,212,440,528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 4.3478円 (1万口当たり純資産額) (43,478円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2022年12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。

## （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12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月11日
期首元本額	125,392,890,332円
期中追加設定元本額	8,852,117,069円
期中一部解約元本額	6,032,566,873円
期末元本額	128,212,440,528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）	1,848,919,410円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,405,730円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	33,098,299,414円
世界経済インデックスファンド	11,889,853,096円
外国株式インデックス・オープン	899,207,715円
D C マイセレクション 2 5	789,075,434円
D C マイセレクション 5 0	3,638,807,565円
D C マイセレクション 7 5	4,352,849,590円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,250,750,518円
D C マイセレクション S 2 5	406,201,052円
D C マイセレクション S 5 0	1,863,139,977円
D C マイセレクション S 7 5	1,658,877,685円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	35,263,376円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	151,417,042円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	113,272,438円
D C 世界経済インデックスファンド	10,111,521,783円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,230,956,803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）	26,207,618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）	10,140,485円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	28,808,544円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	228,475,079円

区分	2022年12月10日現在
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	159,308,282円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,172,872,365円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	88,544,485円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	22,022,313円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	147,585,966円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	47,209,859円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	966,793,660円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,039,363,602円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,174,200,239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）	1,203,089,849円
分散投資コア戦略ファンドA	1,541,300,012円
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）	1,393,968,070円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,155,239,491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）	585,236,166円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,124,531円
SMT インデックスバランス・オープン	155,974,383円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	311,714,378円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	15,884,384,260円
SMT 世界経済インデックス・オープン	218,867,190円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	836,689,192円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	156,405,481円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,408,206円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	354,010,716円
グローバル経済コア	641,039,100円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,524,335円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,611,023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）	84,465,513円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	55,720,470円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	49,038,162円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	19,334,262円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	24,411,873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）	233,098,813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）	179,856,780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）	853,238,581円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,383,364,690円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	102,979,372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）	78,492,186円

区分	2022年12月10日現在
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	73,847,032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）	213,286,445円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	212,187,298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

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2022年12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	13,234,868,982	-	13,666,500,405	431,631,423
合計		13,234,868,982	-	13,666,500,405	431,631,423

(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12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	559,422,840	-	561,378,576	1,955,736
	アメリカドル	436,864,000	-	438,065,920	1,201,920
	カナダドル	35,957,520	-	36,238,500	280,980
	イギリスポンド	86,601,320	-	87,074,156	472,836
合計		559,422,840	-	561,378,576	1,955,736

(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。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	254,112,349
コール・ローン	3,069,384,210
国債証券	300,625,159,742
派生商品評価勘定	33,288,704
未収入金	5,074,826
未収利息	1,572,012,136
前払費用	120,729,130
差入委託証拠金	542,021,971
流動資産合計	306,221,783,068
資産合計	306,221,783,068
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,556,892
前受金	25,833,586
未払金	52,584,403
未払解約金	108,934,488
未払利息	8,620
その他未払費用	1
流動負債合計	216,917,990
負債合計	216,917,990
純資産の部	
元本等	
元本	97,190,616,224
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	208,814,248,854
元本等合計	306,004,865,078
純資産合計	306,004,865,078
負債純資産合計	306,221,783,068

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年12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、最初の利払日までには個別法)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>



	2022年12月10日現在
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
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)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12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,190,616,224口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3,1485円 (1万口当たり純資産額) (31,485円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2022年12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>

## (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12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月11日
期首元本額	99,895,494,586円
期中追加設定元本額	10,503,084,465円
期中一部解約元本額	13,207,962,827円
期末元本額	97,190,616,224円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,256,750,479円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	548,963,474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）	2,224,856,715円

区分	2022年12月10日現在
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,441,238円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,795,599,288円
世界経済インデックスファンド	15,728,498,838円
D Cマイセレクション25	1,922,912,796円
D Cマイセレクション50	1,682,795,434円
D Cマイセレクション75	1,169,941,257円
D C外国債券インデックス・オープン	2,325,164,256円
D CマイセレクションS25	970,922,916円
D CマイセレクションS50	773,482,613円
D CマイセレクションS75	452,342,788円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	25,024,453円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	93,081,979円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	48,511,039円
D C世界経済インデックスファンド	13,542,919,476円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	487,355,566円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,592,694円
マイセレクション75VA1（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VA1（適格機関投資家専用）	20,694,685円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	39,279,339円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	61,302,826円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	68,608,385円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	64,898,484円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,114,087,180円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	409,582,535円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,647,489,802円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	61,650,980円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	35,832,927円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	405,256,357円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	151,312,187円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	198,728,807円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	696,884,441円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	3,263,166,998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	735,210,439円
コア投資戦略ファンド（安定型）	191,540,029円
コア投資戦略ファンド（成長型）	956,949,109円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	604,175,298円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,318,893,356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）	254,429,314円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	108,939,640円

区分	2022年12月10日現在
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）	1,328,421,074円
SMT インデックスバランス・オープン	196,587,555円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	10,025,663,934円
SMT 世界経済インデックス・オープン	292,839,180円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	363,120,535円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	590,224,846円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,915,307円
グローバル経済コア	856,714,379円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	18,318,247円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,843,108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）	20,279,245円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	20,545,472円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	23,770,274円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	10,563,379円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	14,621,607円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	70,286,736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）	150,849,606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）	11,365,683,553円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	328,723,847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）	287,318,548円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	183,270,192円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	999,267,634円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	106,531,493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）	52,071,918円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（2022年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益 (円)
			(円)	
市場取引	債券先物取引 買建	2,963,870,096	うち1年超	25,833,586
			-	
合計		2,963,870,096	-	25,833,586

(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12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	2,939,290,414	-	2,917,184,758	22,105,656
	アメリカドル	1,553,978,319	-	1,532,622,560	21,355,759
	カナダドル	131,515,690	-	127,793,750	3,721,940
	ユーロ	969,744,672	-	970,993,632	1,248,960
	イギリスポンド	168,032,670	-	169,074,606	1,041,936
	オフショア人民元	116,019,063	-	116,700,210	681,147
	売建	63,731,279	-	63,727,397	3,882
	イギリスポンド	63,731,279	-	63,727,397	3,882
合計		3,003,021,693	-	2,980,912,155	22,101,774

### (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。

## 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12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,503,180,726
コール・ローン	53,198,648
株式	110,328,056,749
投資信託受益証券	260,788,874
投資証券	119,030,273
派生商品評価勘定	364,371,711
未収入金	123,603,550
未収配当金	184,749,856
差入委託証拠金	1,004,706,164
流動資産合計	115,941,686,551
資産合計	115,941,686,551
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	817,592

	2022年12月10日現在
項目	金額（円）
前受金	363,511,178
未払解約金	28,733,576
未払利息	149
流動負債合計	393,062,495
負債合計	393,062,495
純資産の部	
元本等	
元本	32,722,768,408
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	82,825,855,648
元本等合計	115,548,624,056
純資産合計	115,548,624,056
負債純資産合計	115,941,686,551

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年12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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p>

	2022年12月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 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12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	32,722,768,408口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.5311円 (1万口当たり純資産額) (35,311円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2022年12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。

	2022年12月10日現在
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月11日
期首元本額	30,557,293,977円
期中追加設定元本額	2,852,178,254円
期中一部解約元本額	686,703,823円
期末元本額	32,722,768,408円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,784,135,024円
世界経済インデックスファンド	6,718,822,951円
DC新興国株式インデックス・オープン	5,652,276,727円
DC世界経済インデックスファンド	5,723,156,560円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	130,145,392円
分散投資コア戦略ファンドA	276,729,621円



区分	2022年12月10日現在
分散投資コア戦略ファンドS	1,486,419,585円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	851,941,689円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	649,453,609円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	343,636,640円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	16,468,772円
S M T インデックスバランス・オープン	83,289,450円
S M T 世界経済インデックス・オープン	189,124,619円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	750,097,388円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	126,536,543円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,182,848円
グローバル経済コア	359,056,434円
M y S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	80,673,588円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	34,573,923円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	30,416,124円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	11,992,791円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	15,180,451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）	1,229,005,815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）	96,328,222円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	68,008,067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）	10,111,442円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年12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	4,444,419,862	-	4,807,931,040	363,511,178
	合計	4,444,419,862	-	4,807,931,040	363,511,178

(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12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	15,017,200	-	15,058,516	41,316
	アメリカドル	15,017,200	-	15,058,516	41,316
	売建	17,795,700	-	17,794,075	1,625
	アメリカドル	17,795,700	-	17,794,075	1,625
合計		32,812,900	-	32,852,591	42,941

## (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。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2022年12月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	979,514,875
コール・ローン	577,665,240
国債証券	84,544,895,505
未収利息	1,139,151,106
前払費用	77,534,131
流動資産合計	87,318,760,857
資産合計	87,318,760,857
負債の部	
流動負債	
前受収益	111,723
未払解約金	31,715,976
未払利息	1,622
流動負債合計	31,829,321
負債合計	31,829,321
純資産の部	
元本等	
元本	47,620,821,554
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	39,666,109,982
元本等合計	87,286,931,536
純資産合計	87,286,931,536
負債純資産合計	87,318,760,857

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	2022年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,620,821,554口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.8330円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (18,330円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2022年12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</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(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>

	2022年12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)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。</p>

（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12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月11日
期首元本額	46,386,185,089円
期中追加設定元本額	4,361,850,826円
期中一部解約元本額	3,127,214,361円
期末元本額	47,620,821,554円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,995,088,177円
世界経済インデックスファンド	13,870,521,532円
DC 新興国債券インデックス・オープン	5,291,439,575円
DC 世界経済インデックスファンド	11,592,594,778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）	3,981,183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（SMA専用）	37,369,285円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	505,397,325円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,697,871,973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）	210,700,578円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	93,964,709円
SMT インデックスバランス・オープン	168,294,209円

区分	2022年12月10日現在
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	1,942,180,440円
SMT 世界経済インデックス・オープン	382,895,888円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	473,981,625円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	769,843,295円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,534,456円
グローバル経済コア	748,213,228円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	19,402,087円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	3,565,644円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	35,804,142円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	28,698,680円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	10,730,306円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	13,021,210円
My SMT 新興国債券インデックス(ノーロード)	16,566,177円
10資産分散投資ファンド	13,984円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	30,549,608円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	230,995,524円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	138,997,915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)	9,929,803円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	258,840,573円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	259,681,915円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	258,343,972円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	250,720,521円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	246,972,169円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

## 【純資産額計算書】

(2022年12月30日現在)

資産総額	4,585,821,843円
負債総額	1,987,668円
純資産総額（ - ）	4,583,834,175円
発行済口数	3,913,047,199口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1714円
（1万口当たり純資産額）	（11,714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12月30日現在)

資産総額	495,521,517,318円
負債総額	195,006,598円
純資産総額（ - ）	495,326,510,720円
発行済口数	261,367,620,775口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8951円
（1万口当たり純資産額）	（18,951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12月30日現在)

資産総額	618,609,160,629円
負債総額	3,144,507,593円
純資産総額（ - ）	615,464,653,036円
発行済口数	460,976,707,310口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3351円
（1万口当たり純資産額）	（13,351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12月30日現在)

資産総額	520,433,243,195円
負債総額	378,783,808円
純資産総額( - )	520,054,459,387円
発行済口数	126,206,606,090口
1口当たり純資産額( / )	4.1207円
(1万口当たり純資産額)	(41,207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12月30日現在)

資産総額	290,749,252,837円
負債総額	241,221,076円
純資産総額( - )	290,508,031,761円
発行済口数	97,853,441,964口
1口当たり純資産額( / )	2.9688円
(1万口当たり純資産額)	(29,688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12月30日現在)

資産総額	111,524,790,726円
負債総額	24,812,538円
純資産総額( - )	111,499,978,188円
発行済口数	33,007,918,133口
1口当たり純資産額( / )	3.3780円
(1万口当たり純資産額)	(33,780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12月30日現在)

資産総額	85,735,918,770円
負債総額	867,467円
純資産総額（ - ）	85,735,051,303円
発行済口数	48,023,298,236口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7853円
（1万口当たり純資産額）	（17,853円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1)名義書換等

該当事項はありません。

##### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### 受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

###### 受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

###### 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

###### 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

###### 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原



則として取得申込者とします。)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。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2022年12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、監査等委員以外取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

#### [ D0（実行） ]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

#### [ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2023年 3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12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	533	13,524,246
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	207,324
単位型公社債投資信託	52	185,394
合計	652	13,916,964

## 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)	
		百万円		百万円
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		15,618
一般管理費	1	6,047
営業利益		4,421
営業外収益	2	2,365
営業外費用	3	1,945
経常利益		4,840
税引前中間純利益		4,840
法人税、住民税及び事業税		1,402
法人税等調整額		90

法人税等合計	1,492
中間純利益	3,347

## 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

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

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額 等 合計	
当期首残高	941	509	431	64,219
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,641
中間純利益				3,347
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	663	270	933	933
当中間期変動額合計	663	270	933	227
当中間期末残高	278	780	502	63,992



## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 第37期中間会計期間

（自 2022年4月1日

至 2022年9月30日）

## 1．資産の評価基準及び評価方法

## （1）有価証券

## 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

## その他有価証券

## 市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

## 市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

## （2）デリバティブ

時価法によっております。

## （3）金銭の信託

時価法によっております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

## （1）有形固定資産

定額法によっております。

## （2）無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3．引当金の計上基準

## （1）賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

## （2）退職給付引当金

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

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

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

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

## 4．収益及び費用の計上基準

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

## （1）投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる中間財務諸表への影響はありません。

(追加情報)

第37期中間会計期間  
(自 2022年4月1日  
至 2022年9月30日)

グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱いの適用

当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月21日。以下、「実務対応報告第42号」）という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項（1）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

## （表示方法の変更）

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

## （中間貸借対照表関係）

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

## （中間損益計算書関係）

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．発行済株式に関する事項

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

## 2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

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

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

#### (リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

#### (金融商品関係)

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1)\*2、\*3及び(注2)参照）。

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

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

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

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

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

#### (1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区 分	中間貸借対照表計上額（百万円）(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	952	12,129	-	13,081
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,978	-	3,978
資産計	952	16,107	-	17,060
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	804	(0)	-	804
ヘッジ会計が適用されているもの	-	22	-	22
デリバティブ取引計	804	21	-	826

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額908百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は13,989百万円であります。

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

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

（2）時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

（注2）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	2,657	1,966	690
小計	2,657	1,966	690

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

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

（デリバティブ取引関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	6,412	-	5	5
	英ポンド	250	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	164	-	1	1
	香港ドル	219	-	0	0
	ユーロ	721	-	0	0
	買建				
	米ドル	259	-	0	0
香港ドル	2	-	0	0	
合計	8,141	-	0	0	

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	13,818	-	804	804
合計		13,818	-	804	804

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)

原則的 処理方法	為替予約取引	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3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。
株式会社東京スター銀行	26,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社静岡銀行	90,845	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

株式会社北國銀行	26,673	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
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。
野村證券株式会社	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。
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。
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
P a y P a y 銀行株式会社	37,250	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【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

**独立監査人の監査報告書**

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

**監査意見**

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

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

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年8月23日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2021年6月11日から2022年6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 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2022年6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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年2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

## 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2022年6月11日から2022年12月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2022年12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中間計算期間（2022年6月11日から2022年12月10日まで）の損益の状況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、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、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、継続企業の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。

## 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、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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 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、経営者に対して、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

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。