【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4月11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】	上坪　直樹
【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】	コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）
【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】

コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）
愛称として、「コアラップ（切替型ワイド）」という名称を用いることがあります。

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①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。
②三井住友トラスト・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。
③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々営業日の基準価額（※）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々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 4月12日から2023年10月10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8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、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。

＜スイッチング＞

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（※）の取扱いを行う場合があります。

＜受付不可日＞に該当する場合は、スイッチングの取扱いは行いません。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

※スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信、その他資産（バンクローン、デリバティブ、為替予約取引等））資産配分変更型）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他（　）	グローバル（日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり（部分ヘッジ） 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（　　）

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

す。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

(1)単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

［投資対象地域による区分］

(1)国内…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)海外…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

(1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［独立した区分］

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

［補足分類］

(1)インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…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。

②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。

③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

①一般…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。

②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。

③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。

④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。

⑤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①から④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①から④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。

①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。

②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、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

＜ファンドの特色＞

1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

●投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。

●今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

●保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。

●市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド※1等に投資し、オルタナティブ運用※2を行います。

※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。

※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、バンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性（相関性）が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

●各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係（相関関係）、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた機動的な調整を行います。

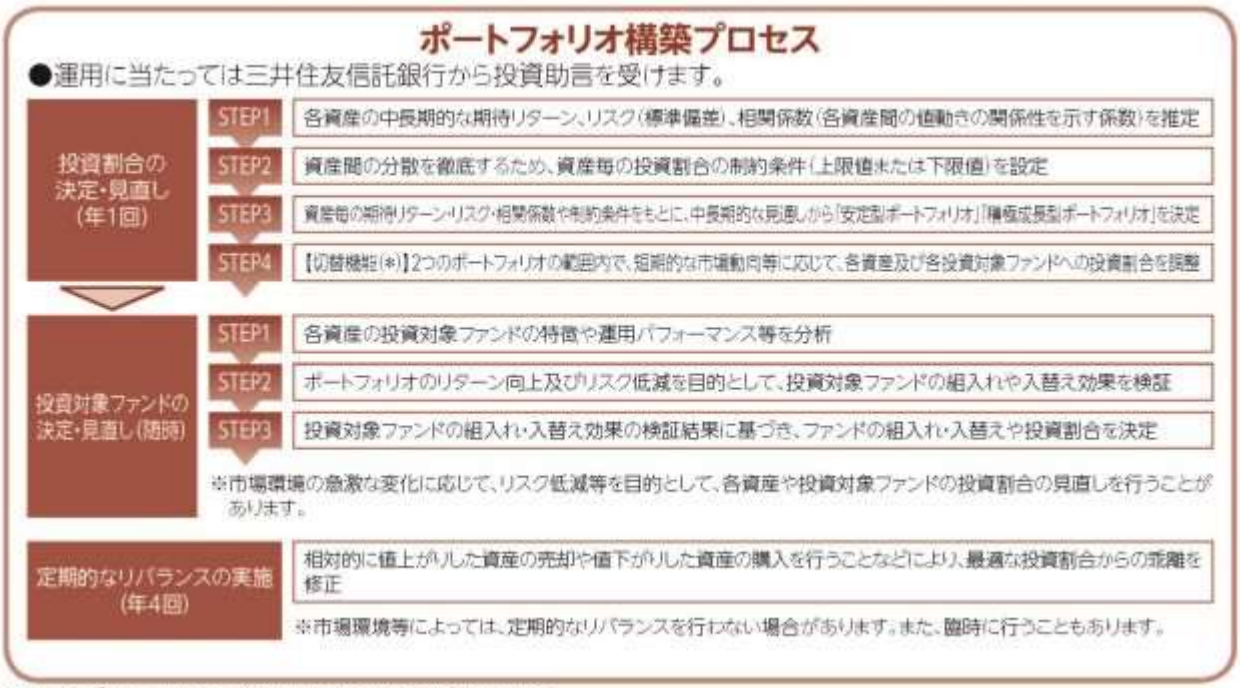
●投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものでもありません。
従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

●「株式」、「リート」、「コモディティ」を実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90%未満とします。

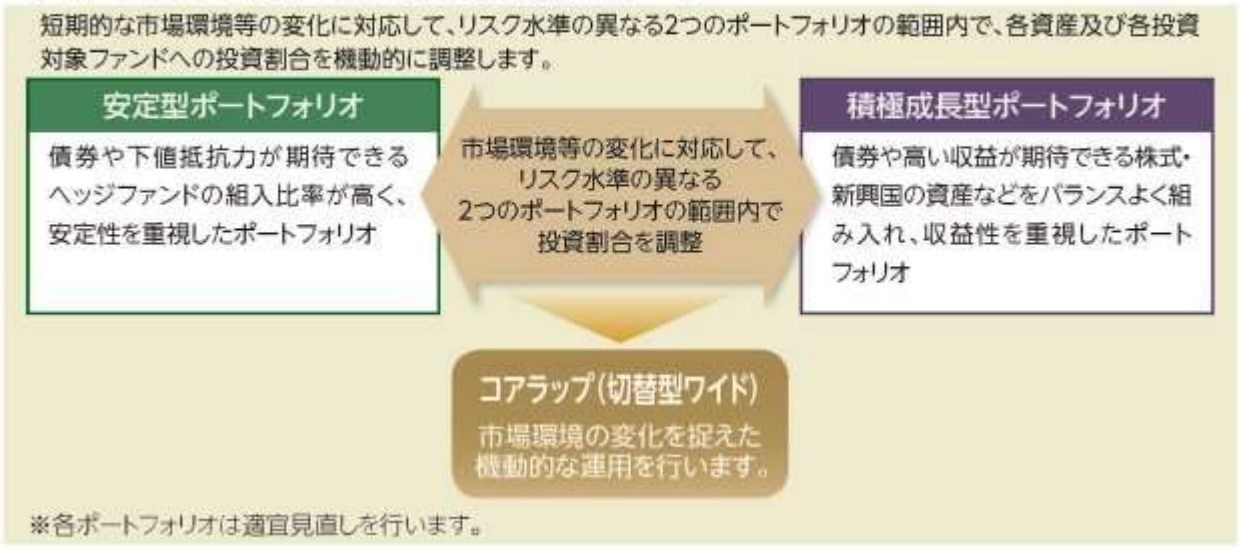
※当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「3　投資リスク　(1)ファンドのリスク　⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

●市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

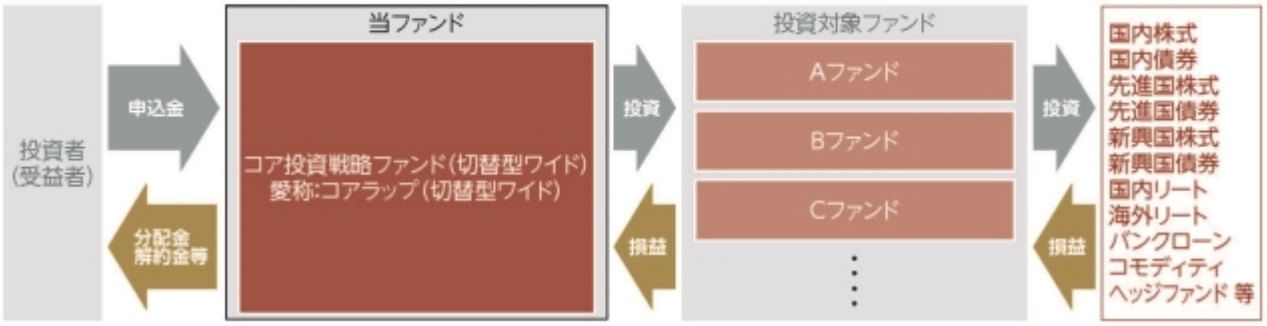
<(*)「コアラップ（切替型ワイド）」の切替機能のイメージ>



※各ポートフォリオは適宜見直しを行います。

ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



※投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「２　投資方針（２）投資対象　(参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。

？ ファンド・オブ・ファンズ方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金を、直接株式や債券といった資産に投資するのではなく、株式や債券等に投資している複数の投資信託に投資して運用を行う仕組みです。

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

●投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
●株式への直接投資は行いません。
●外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
●デリバティブの直接利用は行いません。

〈ご参考情報〉

バンクローン

銀行などの金融機関が、事業拡大などのために資金調達を希望する企業などに対して行う融資(ローン)を指します。一般的に、バンクローンは投資適格未満の格付を有する企業への変動金利のローンです。

コモディティ

金や原油、穀物などの「商品」のことです。商品への投資に際しては、商品インデックスに連動する仕組み債券に投資するファンドなどがあります。

ヘッジファンド

ヘッジとは元々"回避する"という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド※などがあります。
※特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

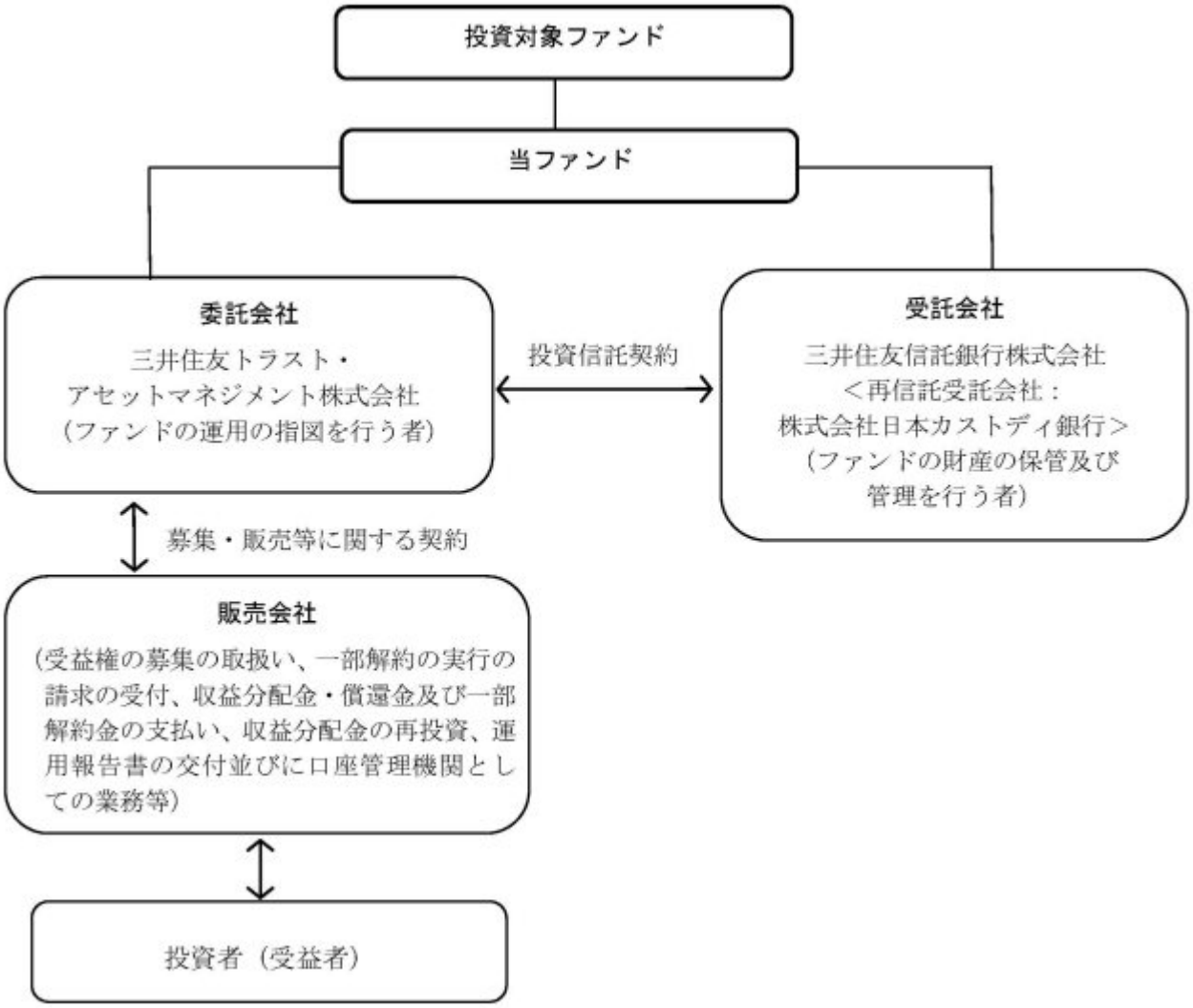
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2018年10月26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】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2023年 1月31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】

①基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

②投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」という場合があります。）を主要投資対象とします。このほか、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資する場合があります。

③投資態度

イ．主として、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内不動産投資信託証券（以下「国内リート」といいます。）、海外不動産投資信託証券（以下「海外リート」といいます。）、貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）、コモディティ[*1]、ヘッジファンド[*2]及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

＊1：コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的にコモディティリンク債券やコモディティ関連デリバティブ等を活用するファンドを指します。

＊2：ヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的に金利、債券、株式、リート、為替、コモディティ等に対する裁定取引やデリバティブ取引等を積極的に活用するファンド、又は各種ヘッジファンド指数に概ね連動する投資成果を目標とするファンドを指します。

ロ．各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じても機動的に調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

※投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90%未満とします。なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

ニ．投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されたり、新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

ヘ．当ファンドでは原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。

ト．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。

（2）【投資対象】

①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. 金銭債権
3. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

②有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、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.コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの
3.国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4.外国法人が発行する譲渡性預金証書
5.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。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

③金融商品の指図範囲

イ．委託会社は、信託金を、上記②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

ロ．上記②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。

④当ファンドが、当ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、下記「（参考）投資対象ファンドの概要」に記載されている通りです。

（参考）投資対象ファンドの概要

・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2023年 1月31日（（★）のファンドに関しては2023年4月5日、（★★）のファンドに関しては2023年4月10日、（★★★）のファンドに関しては2023年4月11日）現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。
なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

1.国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	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。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している株式
投資態度	①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。 ②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。 ③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は、行いません。 ③新株引受権証券およ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。 ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。 ⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1 項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）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。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、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。 ⑦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。 ⑧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およ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、委託者は、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。 ⑨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、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引およ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。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「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。

①同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。

②ＪＰＸは、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

③ＪＰＸは、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
④ＪＰＸは、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、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。
⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではありません。
⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。
⑦ＪＰＸは、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。
⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、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責任を有しません。

2.日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	①主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投資し、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）（※）に連動する投資成果を目指します。 ②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。 ④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。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）
決算日	年1回：4月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年4月23日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、親指数（MSCIジャパンIMI）構成銘柄の中から、親指数における各GICS業種分類の時価総額50%を目標に、ESG評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc.（以下「MSCI」）、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者（総称して「MSCI当事者」）が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定的な投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害（逸失利益を含む）について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

3.国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（※））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。

主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行ないません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。 ⑤デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜　0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標

に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。

4.日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	**ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社**
運用の基本方針	**信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。**
主要投資対象	**日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。**
投資態度	**①主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。** **②信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。** **③事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。** **④投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。** **⑤ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。** **⑥市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。**

主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 ③新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ⑦株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。 ⑧デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑨一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年2回：6月および12月の15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。 ②分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。 ③収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜　0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014年6月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

5.FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本株EVIハイアルファマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)（※）をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ・日本の株式を主要投資対象とします。 ・運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュー指標（ＰＢＲ、ＰＥＲ、配当利回り）等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。 ④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数、配当込み）
決算日	年1回：6月6日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、委託者の判断により分配を行わないことがあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.495%（税抜　0.45%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月17日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、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。「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。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」といいます。）に帰属します。ＪＰＸは、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、ＪＰＸは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

6.国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	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。
主要投資対象	わが国の公社債

投資態度	①NOMURA-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。 ②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。 ③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。 ④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。 ⑤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。
主な投資制限	①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（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。）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。 ②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。 ③外貨建資産への投資は、行いません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤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。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限

受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「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。

7.日本債券ツイン戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債
投資態度	①わが国の公社債に投資しつつ、国債先物取引及び国債に係る選択権付債券売買取引を行うことでNOMURA-BPI総合（※）を上回る投資成果を目指します。 ②ポートフォリオは、クレジット戦略に基づいて事業債を中心とした銘柄選択を行い、金利戦略に基づいてデュレーション等を調整しながら構築します。なお、金利戦略においては、国債先物取引や国債に係る選択権付債券売買取引を活用します。 ③公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④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。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、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。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：2月21日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「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。

8.マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	マニュライフ・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

主要投資対象	主としてマニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど短期金融商品等に直接投資する場合があります。
投資態度	①マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。 ②NOMURA-BPI総合（※）を参考指数として、ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。 ③マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ④大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。
主な投資制限	①債券への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③有価証券先物取引等の直接利用は行いません。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券を除く）への投資は行いません。 ⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑥デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 ⑦同一銘柄の株式、転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑧信用取引、空売り、有価証券の借入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。 ③留保益（収益分配に充てず信託財産内に留保した利益）については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。

信託報酬	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り　　信託報酬 0.5%未満の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.264%（税抜　0.24%） 0.5%以上１%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.297%（税抜　0.27%） １%以上の場合　・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.33%（税抜　0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「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。

9.明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	明治安田アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として、邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等に実質的に投資し、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	明治安田日本債券アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」ということがあります）受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	①主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等へ分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②NOMURA-BPI総合（※）をベンチマークとしてこれを中長期的に上回る投資成果を目指します。 ③信用リスクの低減を図るため、原則として取得時に信用ある格付会社によるBBB格相当以上の格付を有する公社債およびそれと同等の信用度を有すると判断した公社債に投資します。 ④債券市場は、長期的には経済のファンダメンタルズによって変動するという考えを基本としファンダメンタルズ分析を重視したアクティブ運用を行います。 ⑤マクロ経済分析をベースとした金利の方向性予測等に基づき、市況動向やリスク分散等を勘案して、デュレーションの調整、イールドカーブポジショニングのコントロールを行います。 ⑥公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。 ⑦資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦外貨建資産への投資は行いません。 ⑧デリバティブ取引等は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。 ⑨一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月15日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③収益分配金にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.264%以内（税抜　0.24%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年9月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI総合」は、日本国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表すために、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よって計算、公表されている投資収益指数で、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の知的財産です。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、当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。

10.ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）（★）

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドを主要投資対象とします。なお直接、公社債等への投資、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を行う場合があります。 ＜ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンドの主要投資対象＞ わが国の公社債を主要投資対象とします。 ＜ニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの主要投資対象＞ 主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用します。

投資態度	①ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドを通じて、主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用することで、安定したインカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行います。 ②NOMURA-BPI（総合）指数（※）をベンチマークとし、ベンチマークを中長期的に上回る投資成果の獲得をめざします。 ③実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。 ④資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンドの投資態度＞ ①NOMURA-BPI（総合）指数をベンチマークとします。 ②主としてわが国の公社債に投資し、債券種類別構成比の調整や社債の個別銘柄選択等、信用リスクの適切な管理を主な超過収益源として、上記ベンチマークを中長期的に上回ることを目標に運用を行います。 ③公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ④資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜ニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの投資態度＞ ①主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用することで、安定したインカム収益の確保と信託財産の成長をめざした運用を行います。 ②組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。 ③資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債の転換及び新株予約権の行使による取得に限るものとし、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。なお、ここでいう新株予約権とは、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。）の新株予約権をいいます。 ②同一銘柄の転換社債及び転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑤外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。 ⑥デリバティブ取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑧一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取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	NOMURA-BPI（総合）指数
決算日	年1回：6月10日（休業日の場合は翌営業日。第1期決算日は2024年6月10日）
収益の分配	・分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。ただし、ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます。）等の全額とします。 ・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。 ・純資産総額100億円以下の部分　年率0.275%（税抜　0.25%） ・純資産総額100億円超の部分　　年率0.253%（税抜　0.23%）
信託財産留保額	取得申込受付日及び解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.03%の率を乗じて得た額
設定日	2023年4月5日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI（総合）指数」とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、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よって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

11.ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド(適格機関投資家専用)（★★）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「年金日本債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債へ投資することにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として次のような運用を行います。 ・NOMURA-BPI総合指数（※）をベンチマークとし、デュレーション・コントロールを重視したアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または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。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ②株式への実質投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合指数
決算日	年1回：1月27日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づいて分配金額を決定します。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）等の範囲内とします。 ②収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、委託者の判断により分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	毎期、計算期間の開始日の属する月の前月末における日本相互証券株式会社が発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下に定める率とします。 新発10年固定利付国債の利回り　　信託報酬 2%未満の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.2035%（税抜　0.185%） 2%以上3%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.2475%（税抜　0.225%） 3%以上4%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.2915%（税抜　0.265%） 4%以上5%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.3355%（税抜　0.305%） 5%以上の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.3795%（税抜　0.345%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2023年4月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI総合指数」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債券市場の動向を的確に表すための市場指数です。日本の債券市場のベンチマークに多く利用されています。NOMURA-BPI総合指数に関する一切の知的財産権その他の一切の権利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ております。また、同社は、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

12.外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	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

投資態度	①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。 ②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。 ③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。 ④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。 ⑤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。 ⑥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。 ⑦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。 ⑧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。

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③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。 ④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。 ⑤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（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。）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。 ⑥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。 ⑦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。 ⑧一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、委託者は、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。 ⑨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。
ベンチマーク	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「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。

13.外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

主要投資対象	わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式（預託証券（DR）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円ベース）（※）に連動する投資成果を目指します。 ②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③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。 ④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。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円ベース）
決算日	年1回：6月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCIコクサイESGリーダーズ指数」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株式の中から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc.（以下「MSCI」）、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者（総称して「MSCI当事者」）が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定的な投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あ

るいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害（逸失利益を含む）について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

14.グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	**モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社**
運用の基本方針	**投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。**
主要投資対象	**グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢ（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。**
投資態度	**①マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目指します。 ②有力な無形資産（特許、著作権、ブランド等）を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選して投資を行います。 ③実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ④資金状況、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合もあります。**

主な投資制限	①株式の実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 ③新株引受権証券並びに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20%以下とします。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券並びに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5%以下とします。 ⑥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実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑦デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。 ⑧一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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、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ないものとします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年１回：4月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合には委託者の判断で分配を行わないことがあります。 ③収益の分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.814%（税抜0.74%） マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬は、委託者との間で別に定める取決めに基づく金額を、委託者から支払うものとします。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

15.ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、主に「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	①「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）（※）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ④資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資を行います。 ②MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③マクロ分析に基づくトップダウンの投資判断と、ボトムアップの個別銘柄分析に基づく銘柄選択を合わせて、本源的価値に比べて割安と判断される銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。 ④原則として対円での為替ヘッジを行いません。ただし、見通しに基づいて米ドルを基準として相対的な魅力度を判断して、外国為替の予約取引等を通じて個別株式選択の結果とは異なる通貨配分とする場合があります。 ⑤資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑥運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシーに委託します。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②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、信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約券証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑤同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑧為替予約の利用及びデリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑨一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信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)
決算日	年1回：9月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則、毎決算時に分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。 ※分配金は、決算日から起算して５営業日以内に支払われます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.671%（税抜　0.61%） このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年9月24日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を含む世界の主要先進国・新興国の株式で構成されています。MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）は、MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、ドルベース）をもとに、委託者が独自に円換算したものです。MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権は、全てMSCI Inc.に帰属します。MSCI Inc.では、かかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。

16.ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式 マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式等に投資を行う場合があります。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式 マザーファンドへの投資を通じて、実質的に日本を除く世界各国の株式等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長をめざします。 ②上記マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位に保ちます。 ③実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ④資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として日本を除く世界各国の企業が発行する株式等を中心に投資を行います。 ②徹底的なリサーチと行動ファイナンスのアプローチに基づき、市場の懸念によりファンダメンタルズよりも割安に評価されている銘柄を選定します。 ③運用にあたっては、Sanders Capital，LLCに運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の指図に関する権限を除きます。）を委託します。 ④外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑤資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③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、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④同一銘柄の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、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤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。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑧外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。 ⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑩一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取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	・分配対象額の範囲は、経費控除後の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。 ・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7381%（税抜　0.671%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月7日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI KOKUSAI Index（配当込・税引後）」は、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く主要先進国の株式により構成されています。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利は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。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託者が独自に円換算したものです。

17.世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	世界エクイティ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を含む世界の金融商品取引所上場株式（預託証券を含みます。以下同じ。）
投資態度	①主として、世界エクイティ・マザーファンド受益証券に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ③ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている株式に分散投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ②株式の銘柄選定にあたっては、市場動向や銘柄毎の成長性、収益性、流動性等を勘案して行ないます。 ③株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ④外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ⑤ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 ⑥運用指図権限を日興アセットマネジメント ヨーロッパ リミテッドに委託します。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンド及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則として以下の通り収益分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益及び売買益（評価益を含む）等の全額とします。 ②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

信託報酬	純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。 ・純資産総額100億円以下の部分 年率0.704%（税抜　0.64%） ・純資産総額100億円超、200億円以下の部分 年率0.649%（税抜　0.59%） ・純資産総額200億円超の部分 年率0.594%（税抜　0.54%） このほか、有価証券の貸付の指図を行なった場合には、その品貸料（マザーファンド（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として、収受する規定のあるものに限ります。）における品貸料は、この投資信託の時価総額に応じて按分する。）に0.55（税抜 0.5）を乗じて得た額。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年12月16日
信託期間	2022年12月16日から2038年5月20日まで
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

18.Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL

投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	①主として世界各国の金融商品取引所（これに準ずるものを含みます。）に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目標とします。 ②投資にあたっては、サステナビリティ・リスクを勘案し、温室効果ガス排出量及び環境・社会・ガバナンス（ESG）や社会的規範を考慮した運用を行います。 ③市場動向によっては、非上場株式及び債券等に投資を行う場合があります。 ④市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①原則として同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②原則として同一銘柄の転換社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③原則として同一銘柄の新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④純資産総額の10%を超えての借入れは、行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	期中無分配とします。

信託報酬	年率0.525% その他の費用 ファンド管理費用：上限年率0.15% その他、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料及びデリバティブ取引に要する費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年11月7日
信託期間	無期限
関係法人	・管理会社 キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・エス・エイ・アール・エル ・投資顧問会社 キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー ・管理事務代行会社 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・名義書換事務受託会社 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・保管受託銀行 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店）

19.外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	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。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債

投資態度	①FTSE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。 ②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。 ③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。 ④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。 ⑤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。 ⑥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。
主な投資制限	①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（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。）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。 ②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。 ③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤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。
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「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。

20.世界債券総合インデックスマザーファンド（★★★）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（※）（以下「ベンチマーク」ということがあります。）を構成する通貨建ての債券等（ベンチマークを構成する債券以外の証券等や上場投資信託証券を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてベンチマークを構成する通貨建ての債券等に投資し、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。 ②債券等への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③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。 ④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。 ⑤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。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、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。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：4月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.1%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2023年4月21日（予定）
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス」とは、Bloomberg Finance L.P.及び、その関係会社が開発、算出、公表を行なうインデックスであり、円建て債券を除く世界の投資適格債券市場を示すインデックスです。「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。Bloomberg(R)及びブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスは、Bloomberg Finance L.P.及び、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。

21.フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フィデリティ投信株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行ないます。
主要投資対象	フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。
投資態度	①フィデリティ・外国債券・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、世界各国の投資適格債券（除く日本円）を主要な投資対象とし、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的として運用を行ないます。 ②実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行ないません。 ③資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。
主な投資制限	①株式への実質的な直接投資は、原則として行ないません。ただし、転換社債の転換ならびに新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものを除きます。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの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%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月30日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。 ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行なうものではありません。 ③留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.451%（税抜0.41%）
信託財産留保額	換金申込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
設定日	2021年7月16日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

22.新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	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。
主要投資対象	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。）
投資態度	①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。 ②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。 ③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。 ④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者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。 ⑤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。
主な投資制限	①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。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③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。 ④一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、委託者は、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。 ⑤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。
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。

信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「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。

23.Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

運用会社	Wellington Management Company LLP
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	金融商品取引所等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。 ＊この投資信託においては、新興国に所在する企業のほか、新興国に資産を保有している企業、新興国で生産された商品・サービスによる収入の割合が高い企業、新興国に対する商品・サービスの販売による収入の割合が高い企業等にも投資します。
投資態度	①MSCIエマージング・マーケット・インデックス（※）の騰落率を上回る投資成果を追求します。 ②ポートフォリオは、カントリー・アロケーションおよび業種別アナリストの個別銘柄選択による、ファンダメンタルズ分析に基づくボトム・アップ・アプローチで構築します。 ③株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑤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。
主な投資制限	①投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ②投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 ③投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。 ④運用会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 ⑤流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。 ⑥受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス
決算日	毎年12月31日
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	年率0.8%以内 なお、この報酬率には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、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が含まれます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年5月30日
信託期間	原則として無期限
関係法人	・管理会社（マネージメントカンパニー） Wellington Luxembourg S.a r.l. ・運用会社（インベストメントマネージャー） Wellington Management Company LLP ・預託機関（デポジタリー） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch ・管理事務代行会社（アドミニストレーター） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch ・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch

※「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。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。

24.新興国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	新興国の債券

投資態度	①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。 ②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。 ③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者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。 ④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。
主な投資制限	①株式への投資は行いません。 ②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（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。）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。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤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。
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月11日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

25.ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社
運用の基本方針	当ファンドは、主に「ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本を除く世界の公社債に実質的に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指します。
主要投資対象	「ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 主に日本を除く世界の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	①ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。 ②ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（※）をベンチマークとします。 ③ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 ④資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主に、日本を除く世界の公社債に投資します。 ②ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）をベンチマークとします。 ③原則として、取得時において1社以上の格付機関から投資適格（ＢＢＢ－／Ｂａａ３）以上の長期格付けが付与された、あるいはこれに相当する信用力をもつと運用者が判断する公社債を主要な投資対象としますが、取得時において信託財産の20%を上限としてこれを下回る信用力の公社債に投資することがあります。 ④外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、通貨見通しに基づいて相対的に魅力があると判断される通貨に、為替予約取引等を通じて資産配分することがあります。 ⑤資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑥運用の指図に関する権限を下記投資顧問会社に委託します。 ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー（在米国） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ディーティーブイエム・リミターダ（在ブラジル） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーイー・リミテッド（在シンガポール） ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッド（在オーストラリア） ウエスタン・アセット・マネジメント株式会社

主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ②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、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ③同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑥為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦一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信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	毎年10月9日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則、毎決算時に分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。 ＊分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.33%（税抜　0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「Bloomberg(R)」およびブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスは、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。ブルームバーグはフランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社とは提携しておらず、また、フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社が運用するファンドを承認、支持、レビュー、推奨するものではありません。ブルームバーグは、フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社が運用するファンドに関連するいかなるデータもしくは情報の適時性、正確性、または完全性についても保証しません。

26.J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	①わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④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。
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに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、わが国の取引所における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。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。 ⑥一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、委託者は、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。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）

決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「東証REIT指数（配当込み）」とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。

①同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。

②ＪＰＸは、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

③ＪＰＸは、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

④ＪＰＸは、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、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。

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではありません。

⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。

⑦ＪＰＸは、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。

⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、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責任を有しません。

27.グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（※）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券

投資態度	①日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③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。 ④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。
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。
S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's(R)及びS&P(R)は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones(R)はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow

Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者又はいかなる一般人に対して、株式全般又は具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追随するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示又は黙示を問わず、いかなる表明又は保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indices又はそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、及び商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社又は当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成又は計算において当社又は当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格又は数量、あるいは当ファンドの新規設定又は販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、又は償還される計算式の決定又は計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、又は取引に関して、いかなる義務又は責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追随する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、又はホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、当インデックス又はその関連データ、あるいは口頭又は書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、又は完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる誤り、欠落又は中断に対して、いかなる義務又は責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的又は黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックス又はそれに関連するデータの商品性、特定の目的又は使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、又はその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間又は信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、又は派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、又は厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約又は取り決めの第三者受益者は存在しません。

28.グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（※）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	米ドル建て債券

投資態度	①ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。 ②米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。 ③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ④投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、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並びに委託者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（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。 ⑤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。
主な投資制限	①株式への投資割合は、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。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、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。 ③同一銘柄の株式への投資割合は、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。 ④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（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。）への投資割合は、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。 ⑤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割合は、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。 ⑥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。 ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの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、委託者は、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。 ⑨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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index[SM]）及び「ブルームバーグ（Bloomberg[(R)]）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index[SM]）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー及びその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグ及びUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューし又は推奨するものではありません。ブルームバーグ及びUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index[SM]）に関連するいかなるデータ又は情報の適時性、正確性又は完全性も保証するものではありません。

29.ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 ＜別に定める金現物に投資する上場投資信託証券＞（2023年1月31日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
投資態度	①主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 ②投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 ③投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④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。

主な投資制限	①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	LBMA金価格（円ヘッジベース）（※）（2023年1月31日現在） ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※LBMA金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会（London Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

30.BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY

管理会社	BlueBay Funds Management Company S.A.
運用の基本方針	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。

主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。
投資態度	①主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 ②ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。 ③債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。 ⑤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。
主な投資制限	①投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。 ②投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年6月30日（休業日の場合は前営業日）
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率0.74% なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011年5月24日
関係法人	・管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A. ・投資顧問会社 BlueBay Asset Management LLP (2023年4月1日前後にBlueBay Asset Management LLPとRBC Global Asset Management (UK) Limited との統合を予定しており、統合後の新会社名はRBC Global Asset Management (UK) Limitedとなる予定です。) ・副投資顧問会社 RBC Global Asset Management (U.S.) Inc. ・管理事務代行会社／名義書換事務受託会社／保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

31.FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	①マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR － Diversified Alpha」（以下「PTRディバーシファイド・アルファ・ファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。 ※PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。 ②円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 ③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。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②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。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①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。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

32.米国株式LSマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する米ドル建債券（以下「米ドル建債券」といいます。）を主要投資対象とします。
投資態度	①米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建（ロングポジション）と売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用※を行います。 ※米ドル建債券への投資額のうち、マーケット・ニュートラル戦略による運用に用いられない余剰資金は、原則として米ドル建MMFもしくはそれに類するもの又は米ドル建公社債、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券もしくは短期金融商品等により運用されます。 ②米ドル建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。 ④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。

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

33.コモディティLSアルファ・マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてブルームバーグ商品指数（※）の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数」※１といいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※2（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※1この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。 ※2運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乗じる一定数は同値とします。

投資態度	①円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。 ②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③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。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、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。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index[SM]）及び「ブルームバーグ（Bloomberg[(R)]）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的で

の利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index[SM]）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー及びその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグ及びUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューし又は推奨するものではありません。ブルームバーグ及びUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index[SM]）に関連するいかなるデータ又は情報の適時性、正確性又は完全性も保証するものではありません。

34.米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略[※1]に基づいて償還価格が決定される円建債券（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※1）この投資信託において米国株式イントラデイ・トレンド戦略とは、米国株式市場の1日の取引時間中の値動き[※2]を捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までに解消する戦略です。なお、株式市場の値動きによっては、同一日に買い建てポジションと売り建てポジションを同時に構築することや、買い建てポジションの合計額あるいは売り建てポジションの合計額が一時的に投資信託財産の純資産総額の2倍程度になることがあります。 ※2）当該戦略の参照対象は、S&P500のほかダウ・ジョーンズ工業株価平均（NYダウ）やナスダック総合指数等の株価指数、あるいはこれらの株価指数先物も含みます。
投資態度	①円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。 ②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③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。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、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。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一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、委託者は、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。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年10月6日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

35.ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の円建短期公社債等を主要投資対象とし、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を主要取引対象とします。

投資態度	①主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。 ②債券先物取引及び為替予約取引等は、原則として定量的手法に基づいた複数の運用戦略を組み合わせることで行います。 ③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。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、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。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑤為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑥一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、委託者は、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。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

36.ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	野村アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	**この投資信託は、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。**
主要投資対象	**日本成長株投資マザーファンド受益証券および野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、TOPIX（東証株価指数）を対象とした株価指数先物取引（以下、「株価指数先物取引」といいます。）を主要取引対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。**

投資態度	各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。 ①各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。 ②各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲とならない場合があります。 ③非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。 ④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜日本成長株投資マザーファンドの投資態度＞ ①わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。 ②ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。 ③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。 ④非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。 ⑤資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度＞ ①株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。 ②ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。 ③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。 ④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 ⑤新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑦同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑧投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑨一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。 ⑩一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.506%（税抜　0.46%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2019年4月10日
信託期間	無期限
受託会社	野村信託銀行株式会社

37.ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に「ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本の公社債に投資を行うとともに、為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。
主要投資対象	「ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 主に日本の公社債を主要投資対象とし、為替予約取引等を積極的に活用します。

投資態度	①ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。 ②ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主に、日本の公社債に投資するとともに、主要先進国通貨を中心とした為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。 ②モデルによる定量分析とポートフォリオマネージャーによる定性分析を組み合わせた独自のアプローチにより、ポートフォリオを構築します。 ③リスク管理を運用プロセスに組み込み、ポジション・リスクの分散化を図ります。 ④資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑤運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるウエスタン・アセット・マネジメント株式会社及びウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国）に委託します。
主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。 ②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、信託財産の純資産総額の５％以内とします。 ③同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以内とします。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。 ⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑥為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦一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信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.418％（税抜　0.38％） このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05％を上限）をファンドから支弁します。 投資顧問会社の報酬は、委託者が収受する委託者報酬から支弁されます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年4月12日
信託期間	原則として無期限

受託会社	三井住友信託銀行株式会社

38.MA Hedge Fund Strategies Limited

運用会社	UBS O'Connor LLC
運用の基本方針	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。
主要投資対象	主として世界各国（日本を含みます。）の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。
投資態度	①公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。 ②ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。 ③為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。
主な投資制限	①投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 ②投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。 ③一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 ④流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の15%以下とします。 ⑤外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑥一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、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦投資信託証券への投資は行いません。 ⑧デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月31日（決算日が休日の場合は、前営業日となります。）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	運用報酬：年率0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日

関係法人	・運用会社 UBS O'Connor LLC ・保管銀行・管理事務代行会社 MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited

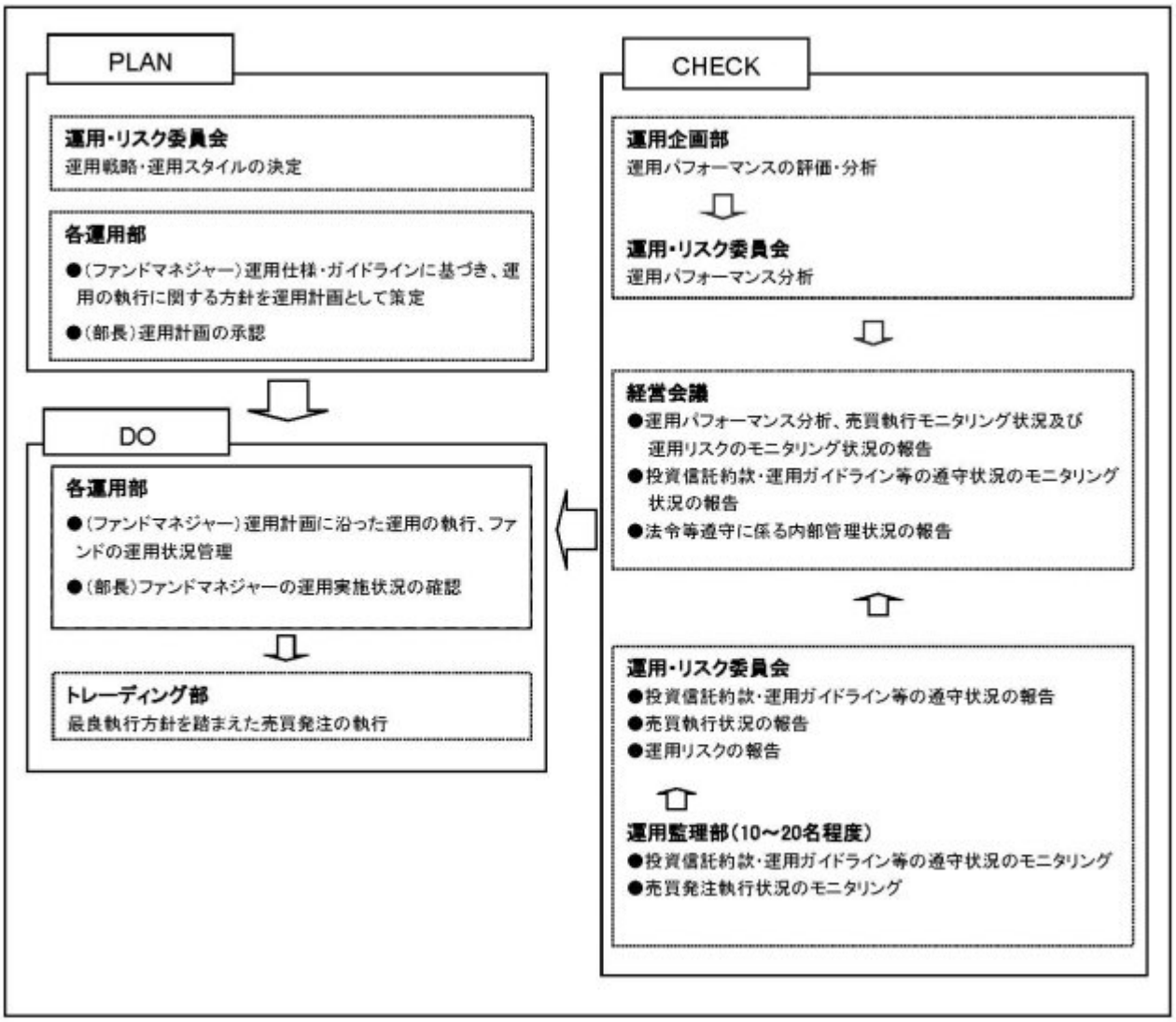
39.MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR

投資顧問会社	Graham Capital Management, L.P.
運用の基本方針	オルタナティブ運用手法を活用して投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物に投資します。
投資態度	・主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物で運用します。 ・トレーディング・アドバイザーの支援を受けて、各先物の市場の非効率性やトレンド等を収益機会として捕捉します。 ・各先物の収益機会の度合、ボラティリティ、流動性及び他先物との相関に係る評価等を鑑みて、各先物のロング・ショート戦略等によりポートフォリオを構築します。 ・先物取引に係る証拠金相当額に対しては、原則として対円での為替ヘッジを行います。 ・資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	・先物での運用割合（想定元本ベース）は、投資信託財産の純資産総額の90%以上とします。 ・現物の空売りは行いません。 ・発行体の法的支配や経営権の取得を企図した有価証券の取得を行いません。 ・投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月の最終ファンド営業日
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	固定報酬：年率0.85% 成功報酬：12% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の12%
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年12月19日
信託期間	原則として無期限

関係法人	・管理会社（マネージャー） SG Kleinwort Hambros Corporate Services (CI) Limited ・投資顧問会社（トレーディング・アドバイザー） Graham Capital Management, L.P. ・副管理会社（サブ・マネージャー） Amundi Asset Management S.A.S ・管理事務代行会社（アドミニストレーター） Societe Generale Securities Services France S.A. ・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） RBC Investor Services Bank S.A. ・保管受託銀行（カストディ） SG Kleinwort Hambros Trust Company (CI) Limited

（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．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ヘ．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たときは、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。

ト．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。

チ．外国為替予約取引の指図

委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

リ．資金の借入れ

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

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ヌ．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。

＜その他の投資制限＞

イ．当ファンドでは直接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かかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、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。

①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。

②金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、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。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固

定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等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。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

③リートの価格変動リスク

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

④商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

⑤為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

⑥信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、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、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受ける可能性があり、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るリスクがより高いものになると想定されます。

⑦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。

⑧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。

⑨資産等の選定・配分に係るリスク

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更します。この投資行動が、ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合があります。

また、投資対象とする資産やファンドの追加に伴い、新たな投資リスクが生じる可能性があります。

⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的に現物有価証券、デリバティブや為替予約取引

等の買建てや売建てによりポートフォリオを組成することがあり、買い建てている対象が下落した場合もしくは売り建てている対象が上昇した場合に損失が発生し、ファンドの基準価額が影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。また、投資対象ファンドの純資産総額を上回る買建て、売建てを行う場合があるため、投資対象ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。

ヘッジファンドのパフォーマンスは、通常、運用者の運用能力に大きく依存することになるため、市場の動向に関わらず、損失が発生する可能性があります。

⑪仕組み債券に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、特定の対象（指数やファンド等）の値動きに概ね連動する投資成果を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。

また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり（1社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。

なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。

⑫ブローカーの信用リスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的にデリバティブや為替予約取引等を行う場合があります。ブローカーの債務不履行等によって、ブローカーで保管されている証拠金の一部又は相当の額が失われる可能性や契約が履行されない可能性があり、ファンドが大きな影響を被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＞

①同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象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。

②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。

③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。

④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。

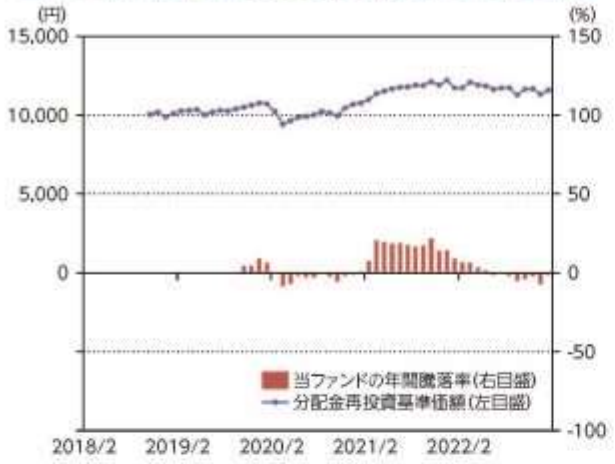
(2)リスクの管理体制

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2019年10月～2023年1月の3年4ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2018年2月～2023年1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。「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章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・ インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村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により運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾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】

①取得申込受付日の翌々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。）。

②「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。

③上記①及び②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。

④当ファンドが投資対象ファンドに投資する際に信託財産留保額（※3）がかかる場合、当該信託財産留保額を当ファンドが負担します。

※3：「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。

（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）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞
ありません。
＜信託財産留保額＞
当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する投資対象ファンド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。

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①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1.518%（税抜　1.38%）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　0.968%　（税抜　0.88%）	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　0.495%　（税抜　0.45%）	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

②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。

③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。

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

各投資対象ファンドの信託報酬（投資信託財産の純資産総額に対する年率）は下記の通りです。
当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。
なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.517%　（税抜　0.47%）
日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.7095%　（税抜　0.645%）
FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.495%　（税抜　0.45%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
日本債券ツイン戦略マザーファンド	ありません。
マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り　信託報酬 0.5%未満の場合・・・・・・・・・・年率　0.264%（税抜　0.24%） 0.5%以上１%未満の場合・・・・・年率　0.297%（税抜　0.27%） １%以上の場合 ・・・・・・・・・・年率　0.33%（税抜　0.3%）
明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.264%以内　（税抜　0.24%以内）
ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	・純資産総額100億円以下の部分 年率0.275%（税抜　0.25%） ・純資産総額100億円超の部分 年率0.253%（税抜　0.23%）

ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド(適格機関投資家専用)	毎期、計算期間の開始日の属する月の前月末における日本相互証券株式会社が発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下に定める率とします。 新発10年固定利付国債の利回り　信託報酬 2%未満の場合・・・・・・・・年率0.2035% （税抜　0.185%） 2%以上3%未満の場合・・・・年率0.2475% （税抜　0.225%） 3%以上4%未満の場合・・・・年率0.2915% （税抜　0.265%） 4%以上5%未満の場合・・・・年率0.3355% （税抜　0.305%） 5%以上の場合・・・・・・・・年率0.3795% （税抜　0.345%）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.814%　（税抜　0.74%）
ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.671%　（税抜　0.61%）
ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	年率　0.7381%　（税抜　0.671%）
世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	・純資産総額100億円以下の部分 年率0.704%（税抜　0.64%） ・純資産総額100億円超、200億円以下の部分 年率0.649%（税抜　0.59%） ・純資産総額200億円超の部分 年率0.594%（税抜　0.54%）
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	年率　0.525%
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
世界債券総合インデックスマザーファンド	ありません。
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.451%　（税抜　0.41%）
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	年率　0.8%以内
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.33%　（税抜　0.3%）
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	年率　0.74%
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.066%　（税抜　0.06%）
米国株式LSマザーファンド	ありません。
コモディティLSアルファ・マザーファンド	ありません。
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ありません。
ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	ありません。
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.506%　（税抜　0.46%）
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率　0.418%　（税抜　0.38%）
MA Hedge Fund Strategies Limited	運用報酬：年率　0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	固定報酬：年率　0.85% 成功報酬：12% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の12%

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況により実質的な信託報酬率は変動します。なお、投資対象ファンドによっては、別途運用実績に基づき計算される成功報酬額がかかる場合があります。

◎実質的な信託報酬率：年率1.518%～2.00946%程度（税抜　1.38%～1.8445%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.49146%程度（税抜　0.0%～0.4645%程度））

（４）【その他の手数料等】

①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（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②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。
③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（※）、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（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
④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。
⑤ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用（※）は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
⑥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
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
ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等
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。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.495%（税抜0.45%）を乗じて得たものとします。
手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

（ご参考）
《　仕組み債券の費用にかかる記載　》
・FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）
実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
・円建債券の連動対象となるPTRディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。
これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・米国株式LSマザーファンド
主要投資対象である米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。
・米ドル建債券の評価額に対して年率0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用として年率0.02%、その他管理費用等がかかります。
・マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率2.00%、純資産価値算出費用として年率0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかります。
・米ドル建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

（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。

①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）」をご利用の場合

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

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。

販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②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。）

③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「④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。）

④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、2023年 1月31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、2023年1月31日現在の状況について記載してあります。

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	4,093,939,295	25.15
	ルクセンブルク	335,018,480	2.06
	小計	4,428,957,775	27.20
投資証券	ルクセンブルク	620,163,630	3.81
	ケイマン	271,638,602	1.67
	小計	891,802,232	5.48
親投資信託受益証券	日本	10,028,992,371	61.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	931,004,167	5.72
合計(純資産総額)		16,280,756,545	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

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

日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス　マザーファンド	1,247,297,494	1.9080	2,379,843,619	1.9790	2,468,401,740	15.16
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	456,682,822	4.2574	1,944,281,447	4.2764	1,952,958,420	12.00
日本	親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	614,848,591	2.1344	1,312,335,717	2.0352	1,251,339,852	7.69
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	867,992,469	1.1998	1,041,442,375	1.2791	1,110,249,167	6.82
日本	親投資信託受益証券	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	345,064,516	2.5581	882,709,539	2.4559	847,443,944	5.21
日本	親投資信託受益証券	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	369,674,499	1.1271	416,660,128	1.2360	456,917,680	2.81
日本	投資信託受益証券	ノムラＦＯＦｓ用　日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	492,410,873	0.9478	466,723,935	0.9244	455,184,611	2.80
日本	投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	419,416,127	1.0348	434,011,808	1.0113	424,155,529	2.61
日本	親投資信託受益証券	日本債券ツイン戦略マザーファンド	440,430,204	0.9572	421,587,371	0.9322	410,569,036	2.52
日本	投資信託受益証券	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	435,943,787	0.968	422,031,291	0.9401	409,830,754	2.52
日本	親投資信託受益証券	米国株式ＬＳマザーファンド	384,407,339	1.0481	402,897,333	1.0318	396,631,492	2.44
日本	投資信託受益証券	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	331,549,705	1.0587	351,033,009	1.1571	383,636,163	2.36
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	175,450,724	2.0694	363,078,118	2.1808	382,622,938	2.35
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	342,557,149	1.039	355,926,831	1.1066	379,073,741	2.33
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	301,319,198	1.1989	361,260,410	1.2476	375,925,831	2.31
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	228,866.447	1,535.14	351,343,094	1,518	347,419,266	2.13
日本	投資信託受益証券	明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	363,190,041	0.9617	349,313,503	0.9394	341,180,724	2.10
日本	投資信託受益証券	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	204,990,570	1.6948	347,422,316	1.6498	338,193,442	2.08
ルクセンブルク	投資信託受益証券	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	28,471.019	11,347.61	323,078,048	11,767	335,018,480	2.06
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	102,830,030	3.1496	323,873,463	3.0038	308,880,844	1.90
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	519,659,866	0.5834	303,169,566	0.5651	293,659,790	1.80
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	25,089.539	10,466.08	262,589,122	10,870.84	272,744,364	1.68
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	26,993	10,237.85	276,350,492	10,063.29	271,638,602	1.67
日本	投資信託受益証券	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	271,674,681	0.9749	264,855,646	0.9547	259,367,817	1.59
日本	親投資信託受益証券	日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	177,935,243	1.0160	180,800,000	1.0620	188,967,228	1.16
日本	親投資信託受益証券	外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	155,144,883	1.1146	172,940,000	1.1146	172,924,486	1.06
日本	投資信託受益証券	ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	144,073,662	1.2348	177,902,157	1.2001	172,902,801	1.06
日本	投資信託受益証券	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	169,475,342	1.0418	176,559,411	1.0141	171,864,944	1.06
日本	親投資信託受益証券	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	150,514,590	0.8431	126,898,851	0.8927	134,364,374	0.83
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	19,402,087	1.7545	34,040,962	1.8392	35,684,318	0.22

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	27.20
投資証券	5.48
親投資信託受益証券	61.60
合計	94.28

(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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【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 (2019年 7月10日)	8,980,843,249	8,980,843,249	10,284	10,284
第2期計算期間末 (2020年 7月10日)	11,787,026,676	11,787,026,676	9,951	9,951
第3期計算期間末 (2021年 7月12日)	12,831,760,694	12,831,760,694	11,807	11,807
第4期計算期間末 (2022年 7月11日)	15,193,556,526	15,193,556,526	11,599	11,599
2022年 1月末日	13,908,762,613	—	11,721	—
2月末日	14,099,772,896	—	11,735	—
3月末日	14,775,142,470	—	12,078	—
4月末日	14,747,238,811	—	11,907	—
5月末日	15,023,198,118	—	11,852	—
6月末日	15,125,123,977	—	11,631	—
7月末日	15,498,730,434	—	11,718	—
8月末日	15,813,005,954	—	11,724	—
9月末日	15,432,012,838	—	11,288	—
10月末日	16,061,532,073	—	11,640	—
11月末日	16,182,826,575	—	11,672	—
12月末日	15,791,031,772	—	11,324	—

2023年 1月末日	16,280,756,545	—	11,582	—

②【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	2018年10月26日～2019年 7月10日	0
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2018年10月26日～2019年 7月10日	2.8
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	△3.2
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	18.7
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	△1.8
第5期中間計算期間	2022年 7月12日～2023年 1月11日	△1.7

(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	2018年10月26日～2019年 7月10日	9,362,328,441	629,077,416	8,733,251,025
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	6,207,727,771	3,096,276,176	11,844,702,620
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	1,926,137,065	2,903,204,631	10,867,635,054
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	3,838,843,288	1,607,580,740	13,098,897,602
第5期中間計算期間	2022年 7月12日～2023年 1月11日	1,447,866,956	533,098,960	14,013,665,598

(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	510,530,134,550	99.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,726,258,442	0.53
合計(純資産総額)		513,256,392,992	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	2,607,660,000	0.51

(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	9,869,300	2,115.60	20,879,491,080	1,896.50	18,717,127,450	3.65
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,271,400	11,930.44	15,168,361,416	11,580.00	14,722,812,000	2.87
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,239,500	738.97	8,305,653,315	952.70	10,707,871,650	2.09
日本	株式	キーエンス	電気機器	179,800	51,535.93	9,266,160,214	59,280.00	10,658,544,000	2.08
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,309,900	3,982.16	9,198,391,384	3,892.00	8,990,130,800	1.75
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,293,600	3,999.49	5,173,740,264	5,652.00	7,311,427,200	1.42
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,595,300	3,751.86	5,985,342,258	4,090.00	6,524,777,000	1.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,042,300	5,370.07	5,597,223,961	6,144.00	6,403,891,200	1.25
日本	株式	任天堂	その他製品	1,134,800	5,831.45	6,617,529,460	5,625.00	6,383,250,000	1.24
日本	株式	第一三共	医薬品	1,570,400	3,554.69	5,582,285,176	4,064.00	6,382,105,600	1.24
日本	株式	日立製作所	電気機器	883,000	6,772.07	5,979,737,810	6,782.00	5,988,506,000	1.17
日本	株式	信越化学工業	化学	303,800	18,160.11	5,517,041,418	19,075.00	5,794,985,000	1.13
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	126,800	58,695.81	7,442,628,708	45,170.00	5,727,556,000	1.12
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,368,000	4,675.91	6,396,644,880	4,144.00	5,668,992,000	1.10
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,393,000	4,529.61	6,309,746,730	4,059.00	5,654,187,000	1.10
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	383,900	13,936.75	5,350,318,325	14,200.00	5,451,380,000	1.06
日本	株式	三井物産	卸売業	1,391,500	3,194.81	4,445,578,115	3,820.00	5,315,530,000	1.04

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,560,100	1,539.08	3,940,198,708	2,027.50	5,190,602,750	1.01
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,189,000	4,482.93	5,330,203,770	4,336.00	5,155,504,000	1.00
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,171,800	3,729.45	4,370,169,510	4,183.00	4,901,639,400	0.96
日本	株式	ダイキン工業	機械	216,700	20,707.13	4,487,235,071	22,470.00	4,869,249,000	0.95
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,782,500	2,476.97	4,415,199,025	2,714.00	4,837,705,000	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,461,000	3,188.82	4,658,866,020	3,207.00	4,685,427,000	0.91
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,896,000	1,492.10	4,321,121,600	1,486.50	4,304,904,000	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	195,600	19,676.23	3,848,670,588	21,580.00	4,221,048,000	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	176,400	21,318.02	3,760,498,728	22,905.00	4,040,442,000	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	545,100	8,205.04	4,472,567,304	7,394.00	4,030,469,400	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	655,400	5,413.00	3,547,680,200	6,127.00	4,015,635,800	0.78
日本	株式	ＳＭＣ	機械	58,900	66,087.57	3,892,557,873	65,350.00	3,849,115,000	0.75
日本	株式	富士通	電気機器	180,900	19,366.05	3,503,318,445	18,510.00	3,348,459,000	0.65

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.30
		建設業	1.95
		食料品	3.40
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.18
		医薬品	5.34
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.71
		鉄鋼	0.84
		非鉄金属	0.75
		金属製品	0.57
		機械	5.21
		電気機器	17.29
		輸送用機器	7.37
		精密機器	2.60
		その他製品	2.30
		電気・ガス業	1.23
		陸運業	2.95
		海運業	0.60

		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	8.87
		卸売業	5.90
		小売業	4.52
		銀行業	6.54
		証券、商品先物取引業	0.76
		保険業	2.40
		その他金融業	1.13
		不動産業	1.89
		サービス業	5.30
		小計	99.47
合計			99.47

(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	132	円	2,540,940,250	2,607,660,000	0.51

(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。

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズ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	9,960,919,590	97.93
投資証券	日本	142,382,800	1.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	68,621,719	0.67
合計(純資産総額)		10,171,924,109	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	67,167,000	0.66

(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	371,600	1,994.32	741,091,961	1,896.50	704,739,400	6.93
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	44,200	9,895.49	437,380,934	11,580.00	511,836,000	5.03
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	418,900	682.51	285,903,967	952.70	399,086,030	3.92
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	45,800	4,685.35	214,589,171	5,652.00	258,861,600	2.54
日本	株式	第一三共	医薬品	61,400	4,114.30	252,618,191	4,064.00	249,529,600	2.45
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	5,200	39,729.08	206,591,256	45,170.00	234,884,000	2.31
日本	株式	日立製作所	電気機器	34,000	6,411.82	218,002,217	6,782.00	230,588,000	2.27
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	56,500	4,247.51	239,984,510	4,059.00	229,333,500	2.25
日本	株式	任天堂	その他製品	38,700	5,995.93	232,042,597	5,625.00	217,687,500	2.14
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	50,500	4,363.52	220,358,110	4,144.00	209,272,000	2.06
日本	株式	ダイキン工業	機械	8,700	22,888.89	199,133,379	22,470.00	195,489,000	1.92
日本	株式	三井物産	卸売業	50,200	3,232.75	162,284,491	3,820.00	191,764,000	1.89
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	64,300	2,825.70	181,692,911	2,714.00	174,510,200	1.72
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	41,700	3,766.06	157,044,742	4,183.00	174,431,100	1.71
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	2,000	78,177.61	156,355,220	78,420.00	156,840,000	1.54
日本	株式	ファナック	電気機器	6,700	20,859.39	139,757,972	22,905.00	153,463,500	1.51
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	7,000	19,728.35	138,098,480	21,580.00	151,060,000	1.49
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	100,700	1,465.89	147,615,467	1,486.50	149,690,550	1.47
日本	株式	村田製作所	電気機器	20,100	7,016.54	141,032,591	7,394.00	148,619,400	1.46
日本	株式	富士通	電気機器	6,900	16,332.96	112,697,478	18,510.00	127,719,000	1.26
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	64,300	1,945.77	125,113,263	1,912.50	122,973,750	1.21
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	34,300	2,352.38	80,686,750	3,041.00	104,306,300	1.03
日本	株式	小松製作所	機械	32,400	2,739.74	88,767,867	3,155.00	102,222,000	1.00
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	20,000	4,926.64	98,532,983	4,835.00	96,700,000	0.95
日本	株式	オリックス	その他金融業	41,900	2,140.82	89,700,500	2,275.00	95,322,500	0.94
日本	株式	パナソニック　ホールディングス	電気機器	77,400	1,059.78	82,027,614	1,200.00	92,880,000	0.91

日本	株式	花王	化学	16,700	5,759.31	96,180,532	5,256.00	87,775,200	0.86
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	12,600	6,887.38	86,781,109	6,836.00	86,133,600	0.85
日本	株式	丸紅	卸売業	54,200	1,346.86	73,000,011	1,586.50	85,988,300	0.85
日本	株式	テルモ	精密機器	22,600	4,239.36	95,809,595	3,763.00	85,043,800	0.84

(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	鉱業	0.51
		建設業	1.73
		食料品	3.44
		繊維製品	0.49
		化学	6.00
		医薬品	6.44
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.96
		ガラス・土石製品	0.47
		鉄鋼	1.12
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.22
		機械	5.35
		電気機器	20.15
		輸送用機器	7.61
		精密機器	1.29
		その他製品	2.94
		電気・ガス業	1.05
		陸運業	2.29
		海運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.02
		情報・通信業	6.14
		卸売業	4.68
		小売業	3.30
		銀行業	7.72
		証券、商品先物取引業	0.83
		保険業	3.98
		その他金融業	1.00
		不動産業	2.18
		サービス業	4.27
		小計	97.93

投資証券	―	―	1.40
合計			99.33

(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	3	円	56,631,650	59,265,000	0.58
	大阪取引所	ミニＴＯＰＩＸ先物	買建	4	円	7,917,352	7,902,000	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。

日本債券ツイン戦略マザーファンド

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	44,022,147,600	51.50
社債券	日本	35,846,154,000	41.93
	フランス	2,367,956,000	2.77
	イギリス	199,274,000	0.23
	小計	38,413,384,000	44.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,048,206,369	3.57
合計(純資産総額)		85,483,737,969	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	売建	日本	1,025,920,000	△1.20

(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（%）
債券オプション	買建	日本	239,861,000	0.28
	売建	日本	85,990,000	△0.10

(注1)評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第３６４回利付国債（１０年）	7,100,000,000	98.07	6,963,558,000	96.25	6,833,821,000	0.100	2031/9/20	7.99
日本	国債証券	第３６９回利付国債（１０年）	5,600,000,000	100.49	5,627,616,000	100.09	5,605,264,000	0.500	2032/12/20	6.56
日本	国債証券	第１５４回利付国債（５年）	4,000,000,000	100.03	4,001,549,000	99.74	3,989,880,000	0.100	2027/9/20	4.67
日本	国債証券	第３６６回利付国債（１０年）	3,300,000,000	99.73	3,291,205,000	97.12	3,205,158,000	0.200	2032/3/20	3.75
日本	国債証券	第４４３回利付国債（２年）	3,000,000,000	99.94	2,998,470,000	100.06	3,001,920,000	0.005	2024/12/1	3.51
日本	国債証券	第１８２回利付国債（２０年）	2,500,000,000	98.09	2,452,433,000	95.45	2,386,325,000	1.100	2042/9/20	2.79
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	2,100,000,000	98.99	2,078,873,000	96.14	2,019,108,000	0.100	2031/12/20	2.36
日本	国債証券	第７６回利付国債（３０年）	1,950,000,000	96.85	1,888,765,500	95.78	1,867,846,500	1.400	2052/9/20	2.19
日本	社債券	第１回東京海上日動火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,500,000,000	100.79	1,511,850,000	94.82	1,422,420,000	0.960	2079/12/24	1.66
日本	社債券	第５回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,200,000,000	100.76	1,209,180,000	92.84	1,114,164,000	1.020	2081/2/7	1.30
日本	社債券	第４回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,100,000,000	102.69	1,129,590,000	92.59	1,018,512,000	1.810	2055/11/4	1.19
日本	社債券	第６回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	1,000,000,000	100.67	1,006,770,000	100.00	1,000,090,000	1.130	9999/99/99	1.17
日本	社債券	第１回アサヒグループＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	101.31	1,013,150,000	99.77	997,780,000	0.970	2080/10/15	1.17
フランス	社債券	第２３回ルノー円貨社債	1,000,000,000	100.01	1,000,140,000	99.69	996,980,000	1.030	2023/7/6	1.17
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	1,000,000,000	98.53	985,300,000	97.85	978,520,000	0.100	2030/3/20	1.14

日本	社債券	第１回大樹生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	100.00	1,000,060,000	97.40	974,040,000	0.740	2051/7/2	1.14
日本	国債証券	第１７５回利付国債（２０年）	1,100,000,000	97.64	1,074,040,000	87.12	958,408,000	0.500	2040/12/20	1.12
日本	国債証券	第１７３回利付国債（２０年）	1,050,000,000	96.22	1,010,320,500	86.26	905,740,500	0.400	2040/6/20	1.06
日本	社債券	第１回ドンキホーテＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	900,000,000	101.56	914,067,000	100.52	904,725,000	1.490	2053/11/28	1.06
日本	国債証券	第７０回利付国債（３０年）	1,050,000,000	95.61	1,003,905,000	80.28	842,971,500	0.700	2051/3/20	0.99
日本	社債券	第３回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約	800,000,000	101.75	814,016,000	99.93	799,480,000	1.300	9999/99/99	0.94
日本	国債証券	第７４回利付国債（３０年）	800,000,000	98.16	785,286,000	86.87	694,960,000	1.000	2052/3/20	0.81
日本	国債証券	第１６９回利付国債（２０年）	800,000,000	95.36	762,936,000	86.43	691,488,000	0.300	2039/6/20	0.81
日本	社債券	第１回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	99.69	697,858,000	95.85	670,950,000	0.740	2081/10/14	0.78
日本	社債券	第１回日本航空株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	101.53	710,752,000	94.10	658,707,000	1.600	2058/10/11	0.77
日本	国債証券	第１７９回利付国債（２０年）	700,000,000	97.02	679,170,000	86.04	602,315,000	0.500	2041/12/20	0.70
日本	社債券	第８回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	600,000,000	100.35	602,106,000	99.63	597,798,000	0.980	9999/99/99	0.70
日本	社債券	第２回住友化学利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	100.51	603,090,000	99.35	596,154,000	0.840	2079/12/13	0.70
日本	国債証券	第１８０回利付国債（２０年）	650,000,000	99.96	649,747,500	90.74	589,816,500	0.800	2042/3/20	0.69
日本	社債券	第１回日本生命第５回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	600,000,000	101.24	607,494,000	94.57	567,462,000	1.050	2050/9/23	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。

(注3）償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	51.50
社債券	44.94
合計	96.43

(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	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（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	売建	7	円	1,021,647,690	1,025,920,000	△1.20

(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	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（%）
債券オプション	店頭	第１８２回利付国債（２０年）コール　オプション	売建	7,000,000	円	7,910,000	—	—
	店頭	第７６回利付国債（３０年）コール　オプション	売建	3,000,000	円	5,370,000	210,000	△0.00
	店頭	第７６回利付国債（３０年）コール　オプション	売建	6,000,000	円	4,740,000	5,490,000	△0.01
	店頭	第１５４回利付国債（５年）コール　オプション	買建	72,000,000	円	5,760,000	37,008,000	0.04
	店頭	第１８２回利付国債（２０年）コール　オプション	売建	5,000,000	円	7,050,000	1,500,000	△0.00
	店頭	第１８２回利付国債（２０年）コール　オプション	売建	11,000,000	円	6,160,000	4,191,000	△0.00
	店頭	第７６回利付国債（３０年）コール　オプション	売建	4,000,000	円	3,200,000	3,420,000	△0.00
	店頭	第１８２回利付国債（２０年）コール　オプション	売建	4,000,000	円	2,440,000	3,612,000	△0.00
	店頭	第７６回利付国債（３０年）コール　オプション	売建	3,000,000	円	2,640,000	6,648,000	△0.01
	店頭	第４４４回利付国債（２年）コール　オプション	買建	50,000,000	円	6,500,000	7,100,000	0.01
	店頭	第１４１回利付国債（２０年）コール　オプション	売建	33,000,000	円	28,380,000	33,957,000	△0.04
	店頭	第１８２回利付国債（２０年）コール　オプション	売建	6,000,000	円	3,660,000	8,784,000	△0.01
	店頭	第１８２回利付国債（２０年）プット　オプション	買建	7,000,000	円	9,989,000	35,910,000	0.04
	店頭	第７６回利付国債（３０年）プット　オプション	買建	3,000,000	円	6,462,000	10,323,000	0.01
	店頭	第７６回利付国債（３０年）プット　オプション	買建	6,000,000	円	6,942,000	17,652,000	0.02
	店頭	第１５４回利付国債（５年）プット　オプション	売建	72,000,000	円	9,900,000	14,328,000	△0.02
	店頭	第１８２回利付国債（２０年）プット　オプション	買建	5,000,000	円	8,700,000	15,900,000	0.02
	店頭	第１８２回利付国債（２０年）プット　オプション	買建	11,000,000	円	9,768,000	35,266,000	0.04
	店頭	第７６回利付国債（３０年）プット　オプション	買建	4,000,000	円	4,756,000	13,260,000	0.02
	店頭	第１８２回利付国債（２０年）プット　オプション	買建	4,000,000	円	3,668,000	8,948,000	0.01
	店頭	第７６回利付国債（３０年）プット　オプション	買建	3,000,000	円	3,798,000	6,459,000	0.01
	店頭	第４４４回利付国債（２年）プット　オプション	売建	50,000,000	円	7,700,000	3,850,000	△0.00

	店頭	第１４１回利付国債（２０年）プット　オプション	買建	33,000,000	円	46,728,000	39,567,000	0.05
	店頭	第１８２回利付国債（２０年）プット　オプション	買建	6,000,000	円	5,670,000	12,468,000	0.01

(注1)評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。

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

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	342,498,988,063	65.86
	イギリス	22,980,472,603	4.42
	カナダ	19,248,838,544	3.70
	フランス	17,597,563,251	3.38
	スイス	17,364,363,784	3.34
	ドイツ	13,254,851,926	2.55
	オーストラリア	11,831,469,908	2.28
	オランダ	10,165,452,040	1.95
	アイルランド	9,346,481,317	1.80
	スウェーデン	4,893,001,395	0.94
	デンマーク	4,466,113,474	0.86
	スペイン	3,991,411,356	0.77
	香港	3,477,952,960	0.67
	イタリア	2,802,909,329	0.54
	フィンランド	1,912,532,862	0.37
	シンガポール	1,873,286,895	0.36
	ジャージー	1,699,887,461	0.33
	ベルギー	1,278,007,292	0.25
	ノルウェー	1,108,670,589	0.21
	イスラエル	1,090,923,939	0.21
	ケイマン	1,037,793,544	0.20
	キュラソー	821,607,533	0.16
	バミューダ	786,930,054	0.15
	ニュージーランド	383,751,169	0.07
	ルクセンブルク	379,918,059	0.07
	オーストリア	303,919,684	0.06
	ポルトガル	288,663,239	0.06
	リベリア	140,709,176	0.03
	マン島	120,337,586	0.02
	パナマ	117,110,008	0.02

	小計	497,263,919,040	95.62
投資信託受益証券	オーストラリア	133,199,046	0.03
	香港	73,505,171	0.01
	小計	206,704,217	0.04
投資証券	アメリカ	9,956,662,420	1.91
	オーストラリア	689,031,036	0.13
	イギリス	260,966,314	0.05
	シンガポール	242,700,902	0.05
	フランス	238,670,273	0.05
	香港	182,536,447	0.04
	カナダ	58,278,167	0.01
	ベルギー	53,453,815	0.01
	小計	11,682,299,374	2.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	10,906,711,669	2.10
合計(純資産総額)		520,059,634,300	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	8,181,170,276	1.57
	買建	カナダ	532,521,202	0.10
	買建	ドイツ	1,696,567,907	0.33
	買建	イギリス	313,004,911	0.06
	買建	オーストラリア	341,382,055	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。

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	—	935,753,758	0.18

(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	1,265,668	19,566.58	24,764,801,643	18,657.20	23,613,833,666	4.54
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	557,986	35,656.14	19,895,630,449	31,666.37	17,669,393,195	3.40
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	722,070	15,083.63	10,891,441,552	13,118.75	9,472,661,950	1.82
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	472,221	14,660.91	6,923,191,423	12,647.76	5,972,538,725	1.15
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	436,836	14,735.28	6,436,901,560	12,779.53	5,582,561,606	1.07
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	196,006	24,464.42	4,795,175,007	25,000.66	4,900,279,638	0.94
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	327,418	12,716.91	4,163,745,533	14,816.17	4,851,081,797	0.93
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,518	66,239.61	4,869,804,310	63,381.02	4,659,645,924	0.90
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	209,202	33,024.56	6,908,805,340	21,744.13	4,548,915,526	0.87
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	206,738	23,558.96	4,870,533,905	21,136.13	4,369,643,311	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	230,844	17,105.92	3,948,799,389	18,152.29	4,190,347,487	0.81
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	102,259	41,565.13	4,250,408,895	40,097.34	4,100,314,413	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	128,824	27,769.23	3,577,343,904	29,890.67	3,850,636,574	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	187,873	19,378.70	3,640,736,215	18,397.57	3,456,407,552	0.66
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	179,617	25,412.94	4,564,597,229	19,186.91	3,446,296,686	0.66
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	215,571	16,439.13	3,543,800,211	15,683.05	3,380,810,944	0.65
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	146,184	23,197.56	3,391,112,988	22,727.87	3,322,451,533	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	80,384	40,251.29	3,235,560,475	40,998.89	3,295,654,999	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	67,952	46,659.98	3,170,639,376	48,420.02	3,290,237,634	0.63
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	63,340	42,153.55	2,670,006,003	44,425.03	2,813,881,717	0.54
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,300	76,593.86	2,473,981,975	85,417.30	2,758,978,919	0.53
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	198,784	12,140.23	2,413,284,176	13,841.56	2,751,481,120	0.53

アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	138,845	19,537.88	2,712,737,295	19,002.95	2,638,465,356	0.51
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	568,705	4,827.39	2,745,360,830	4,605.59	2,619,222,630	0.50
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	323,561	8,427.05	2,726,667,087	7,911.70	2,559,917,823	0.49
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	440,027	7,003.62	3,081,786,122	5,681.96	2,500,219,553	0.48
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	21,799	84,623.15	1,844,700,099	113,078.12	2,464,990,112	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	108,690	22,408.22	2,435,549,703	22,112.05	2,403,359,323	0.46
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	31,635	75,929.62	2,402,033,716	75,861.78	2,399,887,458	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	130,030	14,116.07	1,835,513,024	18,297.34	2,379,203,770	0.46

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	5.66
		素材	4.53
		資本財	6.55
		商業・専門サービス	1.18
		運輸	1.81
		自動車・自動車部品	1.74
		耐久消費財・アパレル	1.73
		消費者サービス	1.96
		メディア・娯楽	5.00
		小売	4.49
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.13
		家庭用品・パーソナル用品	1.75
		ヘルスケア機器・サービス	4.73
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.83
		銀行	6.18
		各種金融	4.83
		保険	3.40
		不動産	0.41
		ソフトウェア・サービス	10.21

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.97
		電気通信サービス	1.45
		公益事業	3.06
		半導体・半導体製造装置	4.52
		小計	95.62
投資信託受益証券	—	—	0.04
投資証券	—	—	2.25
合計			97.90

(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	311	アメリカドル	61,021,009.5	7,961,411,109	62,705,375	8,181,170,276	1.57
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	22	カナダドル	5,318,099	518,142,385	5,465,680	532,521,202	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	38	スイスフラン	4,177,846	589,326,956	4,292,860	605,550,831	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	185	ユーロ	7,383,492.5	1,045,207,198	7,707,100	1,091,017,076	0.21
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	20	オーストラリアドル	3,574,115	328,568,392	3,713,500	341,382,055	0.07
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	25	イギリスポンド	1,903,098.75	306,912,735	1,940,875	313,004,911	0.06

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	5,000,000.00	650,945,000	652,228,060	0.13
	カナダドル	買建	880,000.00	86,049,040	85,727,048	0.02
	ユーロ	買建	600,000.00	84,911,400	84,923,160	0.02
	イギリスポンド	買建	700,000.00	112,891,800	112,875,490	0.02

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

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

外国株式ＥＳＧリーダーズ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	6,188,863,620	62.81
	イギリス	450,800,466	4.57
	フランス	423,915,626	4.30
	カナダ	354,288,154	3.60
	スイス	279,517,580	2.84
	アイルランド	249,982,892	2.54
	オランダ	222,459,512	2.26
	オーストラリア	213,378,498	2.17
	ドイツ	189,453,122	1.92
	デンマーク	136,939,685	1.39
	スウェーデン	90,266,225	0.92
	香港	74,006,003	0.75
	スペイン	69,356,763	0.70
	フィンランド	50,597,111	0.51
	イタリア	40,468,256	0.41
	ノルウェー	36,611,238	0.37
	キュラソー	30,939,011	0.31
	ジャージー	26,936,692	0.27
	シンガポール	23,122,456	0.23
	バミューダ	18,209,514	0.18
	ベルギー	15,629,933	0.16
	ニュージーランド	14,170,925	0.14
	オーストリア	6,726,863	0.07
	イスラエル	5,126,716	0.05
	ポルトガル	5,021,349	0.05
	ルクセンブルク	4,019,237	0.04
	ケイマン	3,898,211	0.04
	小計	9,224,705,658	93.62
投資信託受益証券	オーストラリア	4,286,999	0.04
	香港	1,868,130	0.02
	小計	6,155,129	0.06
投資証券	アメリカ	177,919,337	1.81
	オーストラリア	23,796,199	0.24

	イギリス	8,522,074	0.09
	フランス	7,739,825	0.08
	シンガポール	3,156,205	0.03
	カナダ	1,327,733	0.01
	小計	222,461,373	2.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	400,292,929	4.06
合計(純資産総額)		9,853,615,089	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	289,366,151	2.94
	買建	ドイツ	88,460,844	0.90

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	4,043,441	0.04

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

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

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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	20,730	31,580.63	654,666,594	31,666.37	656,443,927	6.66
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	17,601	13,237.93	233,000,872	12,647.76	222,613,255	2.26
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	16,222	13,309.87	215,912,741	12,779.53	207,309,641	2.10
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	7,306	17,359.00	126,824,887	25,000.66	182,654,832	1.85

アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	7,836	33,395.97	261,690,823	21,744.13	170,387,004	1.73
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	7,718	21,924.16	169,210,707	21,136.14	163,128,729	1.66
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	4,803	24,205.96	116,261,269	29,890.67	143,564,922	1.46
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	7,007	17,148.78	120,161,509	18,397.57	128,911,806	1.31
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	2,997	36,407.96	109,114,664	40,998.89	122,873,682	1.25
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	2,532	38,831.62	98,321,675	48,420.02	122,599,507	1.24
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	2,368	42,835.97	101,435,578	44,425.03	105,198,483	1.07
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	7,429	11,635.23	86,438,159	13,841.56	102,828,966	1.04
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,188	64,094.92	76,144,766	85,417.30	101,475,757	1.03
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	12,074	7,510.14	90,677,453	7,911.70	95,525,875	0.97
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	810	104,700.96	84,807,778	113,078.12	91,593,284	0.93
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	4,053	21,762.87	88,204,942	22,112.05	89,620,161	0.91
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	4,826	14,754.60	71,205,734	18,297.34	88,302,987	0.90
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,142	67,208.76	76,752,412	73,622.91	84,077,370	0.85
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	2,058	45,517.84	93,675,719	40,653.49	83,664,887	0.85
イギリス	株式	ASTRAZENECA	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,532	16,381.95	74,243,025	17,272.01	78,276,781	0.79
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	12,075	5,417.73	65,419,128	6,291.26	75,967,006	0.77
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	2,145	31,170.89	66,861,563	35,343.01	75,810,774	0.77
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	5,360	12,647.30	67,789,549	14,037.26	75,239,753	0.76
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,862	34,932.32	65,043,998	35,790.53	66,641,968	0.68
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	12,337	5,290.17	65,264,889	5,355.79	66,074,424	0.67
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1,375	39,587.35	54,432,608	47,415.40	65,196,185	0.66

アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	2,944	20,231.32	59,561,020	21,494.93	63,281,081	0.64
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	1,468	36,459.97	53,523,246	42,406.66	62,252,983	0.63
アメリカ	株式	NIKE B	耐久消費財・アパレル	3,733	12,195.05	45,524,124	16,487.49	61,547,815	0.62
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS	半導体・半導体製造装置	2,684	20,532.09	55,108,136	22,588.27	60,626,920	0.62

(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	3.62
		素材	4.33
		資本財	5.85
		商業・専門サービス	1.07
		運輸	2.44
		自動車・自動車部品	2.26
		耐久消費財・アパレル	2.63
		消費者サービス	1.33
		メディア・娯楽	5.79
		小売	3.96
		食品・生活必需品小売り	0.74
		食品・飲料・タバコ	2.99
		家庭用品・パーソナル用品	3.30
		ヘルスケア機器・サービス	3.36
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.93
		銀行	5.33
		各種金融	4.97
		保険	4.45
		不動産	0.36
		ソフトウェア・サービス	14.71
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.46
		電気通信サービス	1.23
		公益事業	1.78
		半導体・半導体製造装置	4.73
		小計	93.62
投資信託受益証券	—	—	0.06
投資証券	—	—	2.26
合計			95.94

(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	11	アメリカドル	2,187,194.5	285,363,266	2,217,875	289,366,151	2.94
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	15	ユーロ	593,717.5	84,046,649	624,900	88,460,844	0.90

(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	31,000.00	4,043,020	4,043,441	0.04

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

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

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	141,175,997,299	48.54
	フランス	24,338,618,456	8.37
	イタリア	21,861,421,305	7.52
	ドイツ	18,724,242,123	6.44
	スペイン	14,334,524,733	4.93
	イギリス	13,987,456,898	4.81
	中国	11,351,650,059	3.90
	カナダ	5,939,453,636	2.04
	ベルギー	5,295,246,859	1.82
	オーストラリア	4,723,253,003	1.62
	オランダ	4,547,390,923	1.56

	オーストリア	3,358,234,045	1.15
	メキシコ	2,361,876,425	0.81
	アイルランド	1,848,166,829	0.64
	マレーシア	1,659,781,665	0.57
	フィンランド	1,492,182,998	0.51
	シンガポール	1,344,662,394	0.46
	ポーランド	1,292,713,154	0.44
	イスラエル	982,008,977	0.34
	デンマーク	965,611,754	0.33
	ニュージーランド	660,026,113	0.23
	ノルウェー	588,404,283	0.20
	スウェーデン	586,306,947	0.20
	小計	283,419,230,878	97.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	7,451,476,853	2.56
合計(純資産総額)		290,870,707,731	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	2,325,077,329	0.80
	買建	ドイツ	2,035,149,372	0.70

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	4,725,001,370	1.62
	売建	—	261,876,709	△0.09

(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	12,093.15	1,668,855,439	12,219.33	1,686,267,669	2.750	2032/8/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	12,923.66	1,724,016,929	12,307.50	1,641,820,511	2.625	2029/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	12,562.83	1,633,168,427	12,415.03	1,613,954,672	0.250	2024/3/15	0.55
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	79,870,000	1,915.34	1,529,784,192	1,911.46	1,526,686,533	1.990	2025/4/9	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	13,380,000	11,439.60	1,530,619,765	10,901.38	1,458,604,663	1.250	2031/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	12,779.26	1,493,896,545	12,332.21	1,441,636,285	2.375	2027/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	11,530,000	12,480.28	1,438,976,592	12,249.90	1,412,414,603	2.250	2027/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	12,011.90	1,421,008,241	11,703.56	1,384,531,942	0.750	2026/8/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.5% 04/30/27	11,940,000	11,495.52	1,372,565,112	11,395.22	1,360,590,395	0.500	2027/4/30	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	11,747.05	1,376,755,276	11,394.21	1,335,401,420	1.875	2032/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	12,480.27	1,355,357,424	12,236.65	1,328,901,158	0.750	2024/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	12,050,000	11,435.69	1,378,001,308	10,935.52	1,317,730,942	1.125	2031/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/31/25	10,900,000	11,945.57	1,302,067,377	11,932.14	1,300,603,699	0.250	2025/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	12,941.50	1,313,562,527	12,575.32	1,276,395,021	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	12,000,000	11,092.55	1,331,107,128	10,628.71	1,275,446,184	0.625	2030/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,032.86	1,318,427,891	10,576.22	1,263,858,813	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	11,901.31	1,326,996,099	11,302.98	1,260,282,601	1.625	2031/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	12,397.16	1,252,113,526	12,368.14	1,249,182,975	2.875	2032/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	12,502.95	1,250,295,027	12,328.90	1,232,890,538	0.250	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/29	9,800,000	12,372.82	1,212,536,566	12,473.13	1,222,367,307	2.875	2029/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	11,030,000	11,474.83	1,265,674,466	10,949.79	1,207,762,570	1.375	2031/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,233.67	1,252,554,308	10,738.80	1,197,376,452	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	11,810.08	1,205,809,495	11,375.35	1,161,423,554	1.125	2028/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	11,767.05	1,117,870,053	11,798.10	1,120,820,114	0.750	2026/4/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	12,479.76	1,124,426,494	12,284.82	1,106,862,349	0.375	2024/7/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/30/27	9,880,000	11,056.58	1,092,390,148	11,201.05	1,106,664,065	0.375	2027/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	12,472.11	1,122,490,491	12,295.26	1,106,574,167	0.250	2024/6/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,761.08	1,142,117,309	12,307.50	1,101,521,257	2.250	2027/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	12,680.37	1,115,873,378	12,398.21	1,091,043,146	1.500	2024/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	11,888.42	1,129,400,508	11,438.03	1,086,613,791	1.250	2028/9/30	0.37

(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	97.44
合計	97.44

(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	63	アメリカドル	6,868,770.2	896,168,448	6,868,968.75	896,194,353	0.31
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	47	アメリカドル	5,368,225.42	700,392,370	5,371,218.75	700,782,910	0.24
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	43	アメリカドル	5,550,526.65	724,177,212	5,580,593.75	728,100,066	0.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	25	ユーロ	2,645,002.5	374,426,554	2,642,125	374,019,215	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	36	ユーロ	4,220,455.6	597,447,694	4,215,960	596,811,297	0.21
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	55	ユーロ	7,523,885.5	1,065,081,231	7,518,500	1,064,318,860	0.37

(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	18,920,000.00	2,446,560,304	2,463,323,456	0.85
	カナダドル	買建	2,000,000.00	193,659,382	194,474,200	0.07
	ユーロ	買建	11,420,000.00	1,607,277,783	1,614,780,006	0.56
	イギリスポンド	買建	1,550,000.00	246,707,636	249,520,085	0.09
	オフショア人民元	買建	10,530,000.00	202,992,075	202,903,623	0.07
	オフショア人民元	売建	13,576,338.55	261,940,518	261,876,709	△0.09

(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	マレーシア	9,681,381,802	9.99
	タイ	9,677,334,057	9.99
	中国	9,624,012,881	9.93

	ブラジル	9,581,261,587	9.89
	メキシコ	9,570,592,963	9.88
	インドネシア	9,507,132,000	9.81
	南アフリカ	9,352,596,635	9.65
	ポーランド	6,708,047,590	6.92
	チェコ	5,275,429,427	5.44
	コロンビア	3,457,111,919	3.57
	ルーマニア	3,400,357,554	3.51
	ハンガリー	2,892,674,321	2.99
	チリ	2,141,470,913	2.21
	ペルー	2,126,513,211	2.19
	ウルグアイ	129,439,436	0.13
	ドミニカ共和国	73,234,195	0.08
	フィリピン	65,646,257	0.07
	小計	93,264,236,748	96.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,627,077,768	3.74
合計(純資産総額)		96,891,314,516	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	9,715,788,329	10.03
	売建	—	2,045,382,268	△2.11

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	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	2,216.27	2,307,138,522	2,269.60	2,362,662,823	0.000	2024/1/1	2.44
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	2.39	1,561,070,200	2.55	1,670,559,974	9.850	2027/6/28	1.72
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	205,400,000	794.06	1,631,014,728	809.26	1,662,236,137	10.500	2026/12/21	1.72
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	63,800,000	2,435.69	1,553,972,498	2,429.04	1,549,730,244	10.000	2025/1/1	1.60

ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	1,770.89	1,354,735,530	1,786.18	1,366,434,391	0.000	2026/1/1	1.41
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	182,600,000	657.51	1,200,623,340	687.72	1,255,791,785	8.000	2030/1/31	1.30
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	50,200,000	2,381.61	1,195,569,998	2,334.24	1,171,789,067	10.000	2027/1/1	1.21
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	617.39	1,082,285,544	629.69	1,103,854,211	5.750	2026/3/5	1.14
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	51,250,000	2,117.13	1,085,032,583	2,137.36	1,095,401,002	0.000	2024/7/1	1.13
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000	641.32	1,061,390,625	659.75	1,091,892,042	8.250	2032/3/31	1.13
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	158,100,000	620.13	980,434,431	656.95	1,038,640,584	7.750	2031/5/29	1.07
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000	635.54	959,680,186	648.45	979,160,934	8.875	2035/2/28	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	155,300,000	614.76	954,735,073	620.47	963,599,539	9.000	2040/1/31	0.99
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	158,200,000	586.09	927,202,954	595.54	942,149,026	8.750	2048/2/28	0.97
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	645.96	897,885,419	660.40	917,959,047	7.500	2027/6/3	0.95
マレーシア	国債証券	MGS 3.757% 05/22/40	30,350,000	2,760.05	837,677,518	2,923.99	887,431,264	3.757	2040/5/22	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	669.82	860,056,565	671.93	862,770,809	8.000	2024/9/5	0.89
タイ	国債証券	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000	424.13	763,445,988	442.02	795,649,744	3.775	2032/6/25	0.82
タイ	国債証券	THAIGB 1.45% 12/17/24	197,000,000	395.25	778,649,986	395.66	779,455,906	1.450	2024/12/17	0.80
マレーシア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	27,300,000	2,668.66	728,546,289	2,826.21	771,557,118	2.632	2031/4/15	0.80
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	38,600,000,000	1.74	675,489,925	1.95	753,772,696	7.250	2034/10/18	0.78
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	38,900,000	1,888.71	734,710,260	1,903.08	740,299,045	0.000	2025/7/1	0.76
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	104,250,000	694.01	723,513,652	696.78	726,402,649	10.000	2024/12/5	0.75
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	23,000,000	3,069.86	706,068,830	3,112.95	715,979,910	3.955	2025/9/15	0.74
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	31,700,000	2,306.07	731,026,965	2,244.89	711,632,671	10.000	2029/1/1	0.73
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 04/25/24	24,500,000	2,821.40	691,244,397	2,886.95	707,302,914	2.500	2024/4/25	0.73
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	159,500,000	420.56	670,803,727	436.14	695,645,302	3.650	2031/6/20	0.72
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	113,700,000	595.19	676,739,603	610.45	694,082,048	8.500	2037/1/31	0.72
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	100,100,000	658.06	658,725,160	688.46	689,153,546	8.500	2029/5/31	0.71
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000	621.49	610,925,478	679.88	668,324,204	8.500	2038/11/18	0.69

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	96.26
合計	96.26

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	21,700,000.00	2,822,519,000	2,830,804,060	2.92
	メキシコペソ	買建	99,200,000.00	687,555,200	689,182,080	0.71
	ブラジルレアル	買建	29,998,738.70	763,165,940	763,866,881	0.79
	チェココルナ	買建	61,800,000.00	367,586,400	366,850,980	0.38
	ハンガリーフォリント	買建	289,500,000.00	104,856,900	105,063,024	0.11
	ポーランドズロチ	買建	14,400,000.00	432,619,200	432,735,840	0.45
	ルーマニアレイ	買建	16,300,000.00	469,486,129	469,638,860	0.48
	マレーシアリンギット	買建	24,100,000.00	740,583,360	739,804,930	0.76
	タイバーツ	買建	147,428,501.88	586,782,574	586,765,436	0.61
	インドネシアルピア	買建	79,344,524,000.00	690,074,598	690,297,358	0.71
	南アフリカランド	買建	145,900,000.00	1,104,463,000	1,095,446,380	1.13
	オフショア人民元	買建	49,000,000.00	945,602,000	945,332,500	0.98
	アメリカドル	売建	15,679,218.48	2,040,023,112	2,045,382,268	△2.11

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

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	121,418,819,400	96.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,761,793,130	3.01
合計(純資産総額)		125,180,612,530	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,752,386,000	3.00

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	13,835	640,473.53	8,860,951,287	567,000	7,844,445,000	6.27
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,860	601,306.17	7,131,491,176	557,000	6,606,020,000	5.28
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	59,839	107,667.42	6,442,710,745	100,300	6,001,851,700	4.79
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	19,991	314,341.95	6,284,009,922	294,300	5,883,351,300	4.70
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	38,352	168,274.7	6,453,671,294	151,900	5,825,668,800	4.65
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	38,279	151,760.71	5,809,248,218	146,700	5,615,529,300	4.49
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	17,877	302,190.14	5,402,253,132	282,800	5,055,615,600	4.04
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	23,631	189,384.38	4,475,342,283	178,700	4,222,859,700	3.37
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	26,530	154,236.77	4,091,901,508	147,800	3,921,134,000	3.13
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,858	336,945.73	3,995,502,466	317,500	3,764,915,000	3.01
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	38,246	74,506.61	2,849,579,806	82,200	3,143,821,200	2.51
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	52,200	45,586.75	2,379,628,350	55,300	2,886,660,000	2.31
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	8,111	389,824.63	3,161,867,573	352,000	2,855,072,000	2.28
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	17,723	156,045.19	2,765,588,902	143,900	2,550,339,700	2.04
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	35,638	79,851.16	2,845,735,640	71,000	2,530,298,000	2.02
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,261	432,654.13	2,708,847,507	389,000	2,435,529,000	1.95
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,095	620,390.46	2,540,498,933	583,000	2,387,385,000	1.91
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,997	320,761.48	2,565,129,555	296,100	2,367,911,700	1.89
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	14,519	162,892.79	2,365,040,418	157,300	2,283,838,700	1.82
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,400	516,861.61	2,274,191,084	501,000	2,204,400,000	1.76
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	6,901	335,506.4	2,315,329,666	308,500	2,128,958,500	1.70
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,685	492,902.03	2,309,246,010	453,500	2,124,647,500	1.70
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,946	159,586.44	2,225,592,492	147,600	2,058,429,600	1.64
日本	投資証券	イオンリート投資法人	13,128	160,804.92	2,111,046,989	143,600	1,885,180,800	1.51
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	16,434	116,229.43	1,910,114,452	108,700	1,786,375,800	1.43
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	11,096	171,327.52	1,901,050,161	155,200	1,722,099,200	1.38
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,697	209,829.79	1,824,889,683	193,600	1,683,739,200	1.35
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	4,075	447,170.52	1,822,219,890	408,500	1,664,637,500	1.33
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,517	310,631.16	1,713,752,109	288,900	1,593,861,300	1.27
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	7,952	210,330.38	1,672,547,181	195,800	1,557,001,600	1.24

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	96.99
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の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物	買建	2,068	円	4,027,843,600	3,752,386,000	3.00

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

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

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	65,107,390,012	76.03
	オーストラリア	5,898,551,721	6.89
	イギリス	4,045,720,945	4.72
	シンガポール	3,288,822,380	3.84
	カナダ	1,623,100,241	1.90
	フランス	1,588,465,953	1.86
	香港	1,230,144,011	1.44
	ベルギー	925,771,040	1.08
	スペイン	358,997,966	0.42
	ニュージーランド	330,189,290	0.39
	韓国	224,453,282	0.26
	ガーンジー	176,315,353	0.21
	オランダ	158,842,873	0.19
	イスラエル	120,995,630	0.14

	ドイツ	45,660,745	0.05
	アイルランド	34,365,106	0.04
	イタリア	13,178,026	0.02
	小計	85,170,964,574	99.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	459,723,443	0.54
合計(純資産総額)		85,630,688,017	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	14,349,698	0.02

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	443,673	14,213.28	6,306,051,882	16,672.76	7,397,254,024	8.64
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	44,511	78,370.82	3,488,363,580	94,572.48	4,209,515,844	4.92
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	76,108	37,143.34	2,826,905,330	38,996.17	2,967,921,138	3.47
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	302,080	8,254.20	2,493,431,009	8,841.95	2,670,976,830	3.12
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	157,476	14,748.12	2,322,475,749	16,432.69	2,587,755,314	3.02
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	227,769	8,676.24	1,976,179,132	9,722.62	2,214,512,437	2.59
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	464,353	4,115.52	1,911,055,034	4,420.32	2,052,590,525	2.40
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	137,862	12,684.36	1,748,692,121	14,486.08	1,997,080,526	2.33
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	825,591	1,578.21	1,302,958,395	1,851.47	1,528,557,134	1.79
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	67,027	20,752.78	1,390,996,870	22,606.53	1,515,248,349	1.77
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	71,631	18,638.99	1,335,130,207	20,533.36	1,470,825,726	1.72
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	164,383	7,793.00	1,281,036,723	8,096.96	1,331,003,924	1.55
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	193,249	5,468.72	1,056,826,289	6,690.50	1,292,932,744	1.51
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	64,238	19,772.40	1,270,139,636	19,961.91	1,282,313,175	1.50
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	55,419	19,881.27	1,101,800,606	21,103.52	1,169,536,113	1.37
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	279,270	3,890.37	1,086,465,933	4,148.94	1,158,676,149	1.35
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	59,918	17,461.71	1,046,270,889	19,262.59	1,154,175,916	1.35
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	99,817	10,233.20	1,021,447,612	11,058.63	1,103,839,989	1.29

香港	投資証券	LINK REIT	1,012,000	832.90	842,899,984	1,070.59	1,083,442,140	1.27
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	140,829	6,430.81	905,645,128	7,105.39	1,000,645,841	1.17
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	258,007	3,123.12	805,788,137	3,540.95	913,591,383	1.07
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	30,952	27,065.60	837,734,648	28,643.38	886,570,015	1.04
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	124,874	6,539.54	816,619,238	6,865.33	857,301,393	1.00
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	295,175	2,712.97	800,803,238	2,884.69	851,488,873	0.99
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	341,290	2,194.69	749,026,663	2,417.60	825,105,810	0.96
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	51,702	14,303.33	739,511,251	15,627.69	807,983,170	0.94
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	584,939	1,276.24	746,525,869	1,354.02	792,020,812	0.92
アメリカ	投資証券	UDR INC	145,930	4,905.80	715,904,794	5,396.23	787,473,186	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	84,968	8,085.69	687,025,102	8,826.29	749,952,676	0.88
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	88,507	6,997.64	619,340,219	8,124.36	719,063,341	0.84

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	99.46
合計	99.46

(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の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	110,000.00	14,307,700	14,349,698	0.02

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

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

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　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（%）
社債券	アイルランド	10,108,750,365	45.12
	ルクセンブルク	9,934,925,184	44.34
	イギリス	657,438,330	2.93

	アメリカ	647,587,845	2.89
	ジャージー	600,683,880	2.68
	小計	21,949,385,604	97.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	456,247,677	2.04
合計(純資産総額)		22,405,633,281	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(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 008 10/24/23	47,000,000	23,630.19	11,106,193,515	21,507.97	10,108,750,365	0.000	2023/10/24	45.12
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 031 11/30/23	24,000,000	12,835.80	3,080,592,405	12,756.05	3,061,452,456	0.000	2023/11/30	13.66
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 030 09/29/23	20,000,000	12,302.66	2,460,533,730	12,599.48	2,519,897,580	0.000	2023/9/29	11.25
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 027 02/28/23	18,000,000	14,050.31	2,529,056,574	12,385.51	2,229,393,078	0.000	2023/2/28	9.95
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 028 04/28/23	18,000,000	13,550.61	2,439,110,556	11,801.01	2,124,182,070	0.000	2023/4/28	9.48
イギリス	社債券	BAR USD COM 040 06/30/23	5,000,000	12,799.10	639,955,350	13,148.76	657,438,330	0.000	2023/6/30	2.93
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000	5,174.44	776,166,030	4,317.25	647,587,845	0.000	2036/6/12	2.89
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000	1,769.17	707,669,280	1,501.70	600,683,880	0.000	9999/99/99	2.68

(注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2）投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。
(注3）償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	97.96
合計	97.96

(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。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	32,002,776,217	99.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	144,086,047	0.45
合計(純資産総額)		32,146,862,264	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	32,095,487,427	△99.84

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	6,731,295	4,344.34	29,243,050,949	4,754.32	32,002,776,217	99.55

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.55
合計	99.55

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	売建	246,205,240.00	32,130,702,448	32,095,487,427	△99.84

(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。

米国株式ＬＳ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（%）
社債券	アイルランド	18,420,639,186	92.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,487,027,688	7.47
合計(純資産総額)		19,907,666,874	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	―	18,290,661,000	△91.88

(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(%)

アイルランド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/27	123,000,000	14,983.15	18,429,276,039	14,976.12	18,420,639,186	0.000	2027/10/18	92.53	

(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（%）
社債券	92.53
合計	92.53

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	売建	141,000,000.00	18,260,416,500	18,290,661,000	△91.88

(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。

コモディティＬＳアルファ・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（%）
社債券	アイルランド	23,818,763,000	98.02
	イギリス	329,850,000	1.36
	小計	24,148,613,000	99.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	152,292,317	0.63
合計(純資産総額)		24,300,905,317	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(%)
アイルランド	社債券	ＳＴＡＲ ＨＥＬＩＯＳ ０％ ０７／１３／２３	19,130,000,000	114.21	21,848,373,000	124.51	23,818,763,000	0.000	2023/7/13	98.02
イギリス	社債券	ソシエテ・ジェネラル ０％ ２０２３／０６／３０	300,000,000	100.11	300,340,000	109.95	329,850,000	0.000	2023/6/30	1.36

(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（%）
社債券	99.37
合計	99.37

(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。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	8,310,644,000	99.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	78,117,540	0.93
合計(純資産総額)		8,388,761,540	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(%)
アイルランド	社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　１０／１８／２３	9,320,000,000	78.47	7,313,840,000	89.17	8,310,644,000	0.000	2023/10/18	99.07

(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（%）
社債券	99.07
合計	99.07

(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。

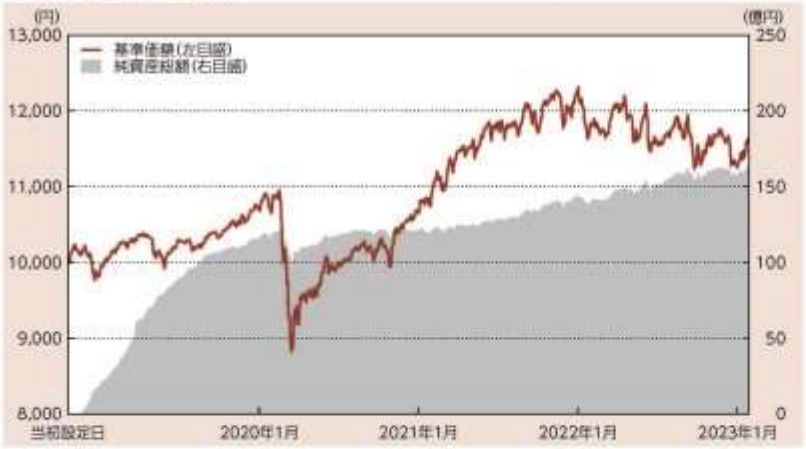
≪参考情報≫

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：2018年10月26日
作成基準日：2023年 1 月31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	11,582円
純資産総額	162.81億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2019年 7 月	0円
2020年 7 月	0円
2021年 7 月	0円
2022年 7 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

投資信託証券	投資比率
国内株式インデックス マザーファンド	15.2%
外国株式インデックス マザーファンド	12.0%
J-REIT インデックス マザーファンド	7.7%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.8%
グローバルREITインデックス マザーファンド	5.2%
コモディティLSアルファ・マザーファンド	2.8%
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	2.8%
FOFs 用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	2.6%
日本債券ツイン戦略マザーファンド	2.5%
マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)	2.5%

※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）

※2018年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2023年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

＜申込コース＞

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

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

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

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

＜申込価額＞

取得申込受付日の翌々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（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

＜その他＞

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファン

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

＜スイッチング＞

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（※）の取扱いを行う場合があります。上記受付不可日の場合は、スイッチングの取扱いは行いません。
販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

※スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。

＜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々営業日の基準価額（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、7営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

＜受付不可日＞

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

＜一部解約受付の中止等＞

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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（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1万口当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＞

①内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

②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。）の評価方法

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。

③外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

④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。

⑤マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

・公社債等（仕組債を含みます。）

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。

・市場デリバティブ取引

金融商品取引所が発表する計算日の清算値段又は帳入値段で評価します。

・店頭デリバティブ取引

計算日における次のa.又はb.のいずれかの価額で評価します。

a.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。）

b.価格情報会社の提供する価額

⑥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。（2018年10月26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7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2018年10月26日から2019年7月10日までとします。

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

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①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10億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

②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。

③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。

④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）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。

①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。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④上記①から③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①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき
・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①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。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④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。

⑤上記①から④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。

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、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＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

②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れ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＞

①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。

②上記①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。

③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。

④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

①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。

②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ます。）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。

③上記②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。

④上記②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。

⑤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

①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。

②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、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。

③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。

④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4期計算期間(2021年7月13日から2022年7月11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】

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 （2021年 7月12日現在）	第4期 （2022年 7月11日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	296,642,623	582,479,964
投資信託受益証券	2,985,986,389	5,668,345,514
投資証券	251,534,902	675,030,861
親投資信託受益証券	9,429,691,996	8,369,881,086
未収入金	-	15,000,000
流動資産合計	12,963,855,910	15,310,737,425
資産合計	12,963,855,910	15,310,737,425
負債の部		
流動負債		
未払解約金	37,508,465	7,738,638
未払受託者報酬	3,414,678	3,950,981
未払委託者報酬	90,830,210	105,096,063
未払利息	452	178
その他未払費用	341,411	395,039
流動負債合計	132,095,216	117,180,899
負債合計	132,095,216	117,180,899
純資産の部		
元本等		
元本	10,867,635,054	13,098,897,602
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,964,125,640	2,094,658,924
（分配準備積立金）	1,543,253,919	1,343,608,716
元本等合計	12,831,760,694	15,193,556,526
純資産合計	12,831,760,694	15,193,556,526
負債純資産合計	12,963,855,910	15,310,737,425

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2020年 7月11日 至　2021年 7月12日	第4期 自　2021年 7月13日 至　2022年 7月11日
営業収益		
受取配当金	-	3,198,433
受取利息	873	4,550
有価証券売買等損益	2,272,271,541	△73,245,562
営業収益合計	2,272,272,414	△70,042,579
営業費用		
支払利息	95,243	223,629
受託者報酬	6,749,570	7,709,621
委託者報酬	179,538,203	205,075,809
その他費用	674,838	770,839
営業費用合計	187,057,854	213,779,898
営業利益又は営業損失（△）	2,085,214,560	△283,822,477
経常利益又は経常損失（△）	2,085,214,560	△283,822,477
当期純利益又は当期純損失（△）	2,085,214,560	△283,822,477
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（△）	262,347,122	19,126,721
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△57,675,944	1,964,125,640
剰余金増加額又は欠損金減少額	198,934,146	726,400,754
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,307,695	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	197,626,451	726,400,754
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	292,918,272
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	292,918,272
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,964,125,640	2,094,658,924

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)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、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)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。 (3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。
３.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第4期計算期間は2021年 7月13日から2022年 7月11日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第3期 (2021年 7月12日現在)		第4期 (2022年 7月11日現在)	
１．計算期間の末日における受益権の総数		10,867,635,054口		13,098,897,602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	1.1807円	1口当たり純資産額	1.1599円
	(1万口当たり純資産額)	(11,807円)	(1万口当たり純資産額)	(11,599円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第3期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日	第4期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	137,722,390円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,349,715,548円
収益調整金額	C	420,871,721円
分配準備積立金額	D	55,815,981円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,964,125,640円
当ファンドの期末残存口数	F	10,867,635,054口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,807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

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	751,050,208円
分配準備積立金額	D	1,343,608,716円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,094,658,924円
当ファンドの期末残存口数	F	13,098,897,602口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,599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4期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11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4期 (2022年 7月11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。

	第4期 (2022年 7月11日現在)
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第3期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日	第4期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	11,844,702,620円	10,867,635,054円
期中追加設定元本額	1,926,137,065円	3,838,843,288円
期中一部解約元本額	2,903,204,631円	1,607,580,740円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第3期 (2021年 7月12日現在)	第4期 (2022年 7月11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)

投資信託受益証券	287,136,981	△42,037,863
投資証券	8,439,101	△22,733,918
親投資信託受益証券	1,749,102,862	69,314,971
合計	2,044,678,944	4,543,190

（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
投資信託受益証券	ノムラＦＯＦｓ用　日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	685,321,328	649,753,151	
	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	151,717,177	178,950,410	
	明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	937,289,283	906,077,549	
	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	11,400.501	133,078,048	
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	85,538,929	142,422,316	
	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	294,529,342	306,840,668	
	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	92,431,635	186,758,118	
	ＬＭ・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	248,762,662	307,172,135	
	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	131,043,414	138,014,923	
	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	373,006,681	363,644,213	
	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	690,978,127	715,024,165	
	ＦＯＦｓ用世界物価連動債ファンド　為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	160,301,232	163,811,828	
	FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	168,231,971	172,336,831	

	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	1,340,796,751	1,304,461,159	
投資信託受益証券合計		5,359,959,932.501	5,668,345,514	
投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	34,541.404	361,513,097	
	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	96,659.904	146,343,094	
	MA Hedge Fund Strategies Limited	16,408	167,174,670	
投資証券合計		147,609.308	675,030,861	
親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	427,010,890	914,315,717	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	247,841,401	624,089,431	
	国内株式インデックス　マザーファンド	696,080,004	1,317,888,271	
	外国株式インデックス　マザーファンド	205,869,265	862,777,502	
	外国債券インデックス　マザーファンド	172,558,497	542,851,775	
	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	806,829,613	470,704,396	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	33,693,326	59,114,940	
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	703,991,983	845,142,375	
	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	571,274,733	643,998,006	
	米国株式ＬＳマザーファンド	542,904,889	569,018,614	
	日本債券ツイン戦略マザーファンド	1,385,126,729	1,332,491,913	
	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	222,379,488	187,488,146	
親投資信託受益証券合計		6,015,560,818	8,369,881,086	
合計			14,713,257,461	

(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 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,991,025,485
株式	496,512,658,660
派生商品評価勘定	41,391,850
未収入金	146,155,300
未収配当金	738,641,138
差入委託証拠金	130,320,000
流動資産合計	499,560,192,433
資産合計	499,560,192,433
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	121,650
前受金	41,303,200
未払解約金	144,034,951
未払利息	608
流動負債合計	185,460,409
負債合計	185,460,409
純資産の部	
元本等	
元本	263,755,440,320
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	235,619,291,704
元本等合計	499,374,732,024
純資産合計	499,374,732,024
負債純資産合計	499,560,192,433

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11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。

	2022年 7月11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。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	263,755,440,320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　1.8933円 (1万口当たり純資産額)　(18,933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 7月11日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11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 7月11日現在
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	251,095,419,520円
期中追加設定元本額	36,066,794,774円
期中一部解約元本額	23,406,773,974円
期末元本額	263,755,440,320円
期末元本額の内訳	

区分	2022年 7月11日現在
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	400,221,389円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	4,007,775,587円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	14,370,549円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	11,961,751,699円
世界経済インデックスファンド	3,968,855,016円
日本株式インデックス・オープン	3,296,225,287円
ＤＣマイセレクション２５	6,244,201,141円
ＤＣマイセレクション５０	19,065,779,456円
ＤＣマイセレクション７５	19,022,256,983円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	6,208,111,264円
ＤＣマイセレクションＳ２５	3,190,241,485円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,327,956,294円
ＤＣマイセレクションＳ７５	7,141,183,428円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	8,450,630,101円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	196,748,599円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	709,996,032円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	519,639,649円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,677,551,196円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,727,257,533円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,324,278円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	18,158,121円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	21,109,086円
日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	173,782,661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）	29,585,940円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	111,278,049円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	25,662,277円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	70,731,569円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	891,920,563円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	434,614,119円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,798,847,146円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	50,709,593円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	18,428,736円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	474,957,123円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	273,810,169円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	347,592,571円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	35,108,426円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	585,589,769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	1,898,971,617円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,035,970,286円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,440,100,504円

区分	2022年 7月11日現在
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）	493,236,576円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	432,747,507円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,817,511,992円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	221,406,255円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	11,298,534円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	58,355,592円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	30,593,626,151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	48,296,197円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	182,985,648円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	32,689,129円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	8,889,766円
グローバル経済コア	219,862,164円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	28,345,430円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	106,531,452円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	24,249,989円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	696,080,004円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	211,083,787円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	18,351,027円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	14,839,165円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	5,677,543円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	7,096,855円
１０資産分散投資ファンド	32,436円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	44,810,496,769円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	920,469,451円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	309,822,187円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	52,217,377円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	144,428,377円
ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用）	46,643,343,632円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,533,345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）	179,832,545円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△1,829,041,016
合計	△1,829,041,016

(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 7月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,665,216,800	－	2,706,520,000	41,303,200
合計		2,665,216,800	－	2,706,520,000	41,303,200

(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はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	8,900	3,535.00	31,461,500	
日本水産	254,300	583.00	148,256,900	
マルハニチロ	36,300	2,524.00	91,621,200	
雪国まいたけ	20,000	955.00	19,100,000	
カネコ種苗	7,700	1,594.00	12,273,800	
サカタのタネ	29,700	4,410.00	130,977,000	
ホクト	20,900	1,952.00	40,796,800	
ホクリヨウ	3,700	617.00	2,282,900	
住石ホールディングス	47,900	187.00	8,957,300	
日鉄鉱業	5,200	5,250.00	27,300,000	
三井松島ホールディングス	11,500	2,913.00	33,499,500	
ＩＮＰＥＸ	955,200	1,404.00	1,341,100,800	
石油資源開発	32,200	3,135.00	100,947,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	10,600	1,539.00	16,313,400	
ショーボンドホールディングス	32,000	6,010.00	192,320,000	
ミライト・ワン	88,200	1,643.00	144,912,600	
タマホーム	16,600	2,401.00	39,856,600	
サンヨーホームズ	3,200	723.00	2,313,600	
日本アクア	10,900	589.00	6,420,100	

ファーストコーポレーション	6,700	734.00	4,917,800	
ベステラ	5,500	1,142.00	6,281,000	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	45,700	184.00	8,408,800	
キャンディル	4,000	535.00	2,140,000	
ダイセキ環境ソリューション	5,300	836.00	4,430,800	
第一カッター興業	6,000	1,289.00	7,734,000	
安藤・間	124,700	870.00	108,489,000	
東急建設	73,500	633.00	46,525,500	
コムシスホールディングス	88,300	2,609.00	230,374,700	
ビーアールホールディングス	34,400	338.00	11,627,200	
高松コンストラクショングループ	17,400	2,072.00	36,052,800	
東建コーポレーション	7,600	8,300.00	63,080,000	
ソネック	2,800	1,006.00	2,816,800	
ヤマウラ	11,900	964.00	11,471,600	
オリエンタル白石	92,100	243.00	22,380,300	
大成建設	176,000	4,290.00	755,040,000	
大林組	587,400	973.00	571,540,200	
清水建設	543,200	763.00	414,461,600	
飛島建設	16,900	1,044.00	17,643,600	
長谷工コーポレーション	169,500	1,605.00	272,047,500	
松井建設	21,100	638.00	13,461,800	
錢高組	2,400	3,185.00	7,644,000	
鹿島建設	430,400	1,508.00	649,043,200	
不動テトラ	13,400	1,622.00	21,734,800	
大末建設	6,600	1,533.00	10,117,800	
鉄建建設	12,800	1,831.00	23,436,800	
西松建設	38,300	4,045.00	154,923,500	
三井住友建設	142,600	460.00	65,596,000	
大豊建設	9,200	4,280.00	39,376,000	
佐田建設	13,600	449.00	6,106,400	
ナカノフドー建設	15,100	305.00	4,605,500	
奥村組	31,500	2,980.00	93,870,000	
東鉄工業	24,900	2,378.00	59,212,200	
イチケン	4,600	1,816.00	8,353,600	
富士ピー・エス	8,200	454.00	3,722,800	
淺沼組	7,100	5,390.00	38,269,000	
戸田建設	242,500	725.00	175,812,500	
熊谷組	31,300	2,771.00	86,732,300	
北野建設	3,900	2,128.00	8,299,200	
植木組	5,200	1,338.00	6,957,600	
矢作建設工業	25,100	798.00	20,029,800	
ピーエス三菱	20,800	618.00	12,854,400	

日本ハウスホールディングス	42,600	405.00	17,253,000	
大東建託	64,700	12,170.00	787,399,000	
新日本建設	26,900	736.00	19,798,400	
東亜道路工業	3,300	5,710.00	18,843,000	
日本道路	5,500	6,630.00	36,465,000	
東亜建設工業	14,100	2,484.00	35,024,400	
日本国土開発	49,200	527.00	25,928,400	
若築建設	9,700	2,305.00	22,358,500	
東洋建設	70,900	874.00	61,966,600	
五洋建設	232,800	703.00	163,658,400	
世紀東急工業	30,400	822.00	24,988,800	
福田組	6,800	4,820.00	32,776,000	
住友林業	138,600	2,032.00	281,635,200	
日本基礎技術	15,500	613.00	9,501,500	
巴コーポレーション	23,000	450.00	10,350,000	
大和ハウス工業	500,600	3,256.00	1,629,953,600	
ライト工業	34,800	1,879.00	65,389,200	
積水ハウス	600,300	2,379.00	1,428,113,700	
日特建設	13,100	824.00	10,794,400	
北陸電気工事	11,300	768.00	8,678,400	
ユアテック	36,200	740.00	26,788,000	
日本リーテック	12,000	952.00	11,424,000	
四電工	6,100	1,758.00	10,723,800	
中電工	25,500	2,148.00	54,774,000	
関電工	102,800	855.00	87,894,000	
きんでん	128,500	1,605.00	206,242,500	
東京エネシス	18,700	1,033.00	19,317,100	
トーエネック	6,400	3,645.00	23,328,000	
住友電設	15,600	2,616.00	40,809,600	
日本電設工業	27,000	1,792.00	48,384,000	
エクシオグループ	87,800	2,124.00	186,487,200	
新日本空調	13,700	1,857.00	25,440,900	
九電工	39,900	2,741.00	109,365,900	
三機工業	41,100	1,582.00	65,020,200	
日揮ホールディングス	178,600	1,717.00	306,656,200	
中外炉工業	5,900	1,643.00	9,693,700	
ヤマト	15,200	773.00	11,749,600	
太平電業	11,500	2,904.00	33,396,000	
高砂熱学工業	48,400	1,653.00	80,005,200	
三晃金属工業	2,500	2,668.00	6,670,000	
朝日工業社	7,700	1,869.00	14,391,300	
明星工業	31,800	706.00	22,450,800	

大氣社	26,400	3,165.00	83,556,000	
ダイダン	11,900	2,139.00	25,454,100	
日比谷総合設備	17,200	1,933.00	33,247,600	
フィル・カンパニー	3,300	1,290.00	4,257,000	
テスホールディングス	17,600	1,188.00	20,908,800	
インフロニア・ホールディングス	220,200	953.00	209,850,600	
東洋エンジニアリング	26,600	649.00	17,263,400	
レイズネクスト	27,100	1,184.00	32,086,400	
ニップン	49,400	1,662.00	82,102,800	
日清製粉グループ本社	190,600	1,644.00	313,346,400	
日東富士製粉	2,900	4,670.00	13,543,000	
昭和産業	16,000	2,611.00	41,776,000	
鳥越製粉	14,700	667.00	9,804,900	
中部飼料	20,900	1,094.00	22,864,600	
フィード・ワン	24,100	697.00	16,797,700	
東洋精糖	3,400	936.00	3,182,400	
日本甜菜製糖	10,600	1,717.00	18,200,200	
DM三井製糖ホールディングス	16,400	1,935.00	31,734,000	
塩水港精糖	24,100	208.00	5,012,800	
日新製糖	9,600	1,776.00	17,049,600	
森永製菓	40,700	4,405.00	179,283,500	
中村屋	4,100	3,215.00	13,181,500	
江崎グリコ	47,200	4,090.00	193,048,000	
名糖産業	7,300	1,689.00	12,329,700	
井村屋グループ	9,800	2,300.00	22,540,000	
不二家	11,300	2,443.00	27,605,900	
山崎製パン	124,100	1,738.00	215,685,800	
第一屋製パン	3,900	494.00	1,926,600	
モロゾフ	6,000	3,680.00	22,080,000	
亀田製菓	10,500	4,775.00	50,137,500	
寿スピリッツ	17,500	6,370.00	111,475,000	
カルビー	92,300	2,838.00	261,947,400	
森永乳業	34,300	5,140.00	176,302,000	
六甲バター	13,400	1,425.00	19,095,000	
ヤクルト本社	128,500	8,110.00	1,042,135,000	
明治ホールディングス	111,500	7,060.00	787,190,000	
雪印メグミルク	44,300	1,907.00	84,480,100	
プリマハム	25,300	2,333.00	59,024,900	
日本ハム	70,900	4,285.00	303,806,500	
林兼産業	6,100	486.00	2,964,600	
丸大食品	18,300	1,590.00	29,097,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	18,200	3,185.00	57,967,000	

柿安本店	7,000	2,434.00	17,038,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	130,300	699.00	91,079,700	
サッポロホールディングス	59,200	2,975.00	176,120,000	
アサヒグループホールディングス	412,700	4,584.00	1,891,816,800	
キリンホールディングス	744,100	2,224.50	1,655,250,450	
宝ホールディングス	112,500	1,032.00	116,100,000	
オエノンホールディングス	53,400	313.00	16,714,200	
養命酒製造	5,400	1,805.00	9,747,000	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,200	1,552.00	200,518,400	
サントリー食品インターナショナル	135,400	5,290.00	716,266,000	
ダイドーグループホールディングス	10,400	5,140.00	53,456,000	
伊藤園	61,500	6,330.00	389,295,000	
キーコーヒー	18,500	2,123.00	39,275,500	
ユニカフェ	6,100	920.00	5,612,000	
ジャパンフーズ	2,900	1,145.00	3,320,500	
日清オイリオグループ	23,200	3,255.00	75,516,000	
不二製油グループ本社	43,900	2,314.00	101,584,600	
かどや製油	1,800	3,595.00	6,471,000	
Ｊ－オイルミルズ	18,900	1,640.00	30,996,000	
キッコーマン	121,400	7,760.00	942,064,000	
味の素	403,500	3,490.00	1,408,215,000	
ブルドックソース	7,200	1,919.00	13,816,800	
キユーピー	88,600	2,319.00	205,463,400	
ハウス食品グループ本社	63,100	2,992.00	188,795,200	
カゴメ	76,800	3,430.00	263,424,000	
焼津水産化学工業	8,200	945.00	7,749,000	
アリアケジャパン	18,500	5,540.00	102,490,000	
ピエトロ	2,600	1,833.00	4,765,800	
エバラ食品工業	4,400	3,065.00	13,486,000	
やまみ	1,700	1,670.00	2,839,000	
ニチレイ	75,500	2,417.00	182,483,500	
東洋水産	90,300	5,430.00	490,329,000	
イートアンドホールディングス	7,600	2,340.00	17,784,000	
大冷	2,300	1,914.00	4,402,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,400	485.00	5,044,000	
日清食品ホールディングス	65,300	9,790.00	639,287,000	
永谷園ホールディングス	9,000	2,040.00	18,360,000	
一正蒲鉾	7,900	804.00	6,351,600	
フジッコ	18,800	2,011.00	37,806,800	
ロック・フィールド	20,100	1,482.00	29,788,200	
日本たばこ産業	1,085,400	2,380.00	2,583,252,000	
ケンコーマヨネーズ	10,300	1,496.00	15,408,800	

わらべや日洋ホールディングス	12,100	2,236.00	27,055,600	
なとり	11,300	2,068.00	23,368,400	
イフジ産業	3,500	963.00	3,370,500	
ピックルスコーポレーション	9,700	1,130.00	10,961,000	
ファーマフーズ	25,500	1,418.00	36,159,000	
ユーグレナ	104,500	926.00	96,767,000	
紀文食品	15,700	1,003.00	15,747,100	
ミヨシ油脂	7,100	1,041.00	7,391,100	
理研ビタミン	14,200	1,734.00	24,622,800	
片倉工業	17,900	2,126.00	38,055,400	
グンゼ	11,600	3,800.00	44,080,000	
東洋紡	78,600	1,024.00	80,486,400	
ユニチカ	56,500	236.00	13,334,000	
富士紡ホールディングス	8,200	3,320.00	27,224,000	
倉敷紡績	14,000	2,052.00	28,728,000	
シキボウ	10,400	903.00	9,391,200	
日本毛織	49,300	999.00	49,250,700	
トーア紡コーポレーション	7,300	370.00	2,701,000	
帝国繊維	20,900	1,692.00	35,362,800	
帝人	173,900	1,432.00	249,024,800	
東レ	1,226,700	709.30	870,098,310	
住江織物	3,400	1,702.00	5,786,800	
日本フエルト	12,400	411.00	5,096,400	
イチカワ	2,700	1,391.00	3,755,700	
日東製網	2,100	1,308.00	2,746,800	
アツギ	14,500	496.00	7,192,000	
ダイニック	6,400	622.00	3,980,800	
セーレン	36,700	2,052.00	75,308,400	
ソトー	7,500	844.00	6,330,000	
東海染工	2,500	1,134.00	2,835,000	
小松マテーレ	29,900	1,111.00	33,218,900	
ワコールホールディングス	40,500	2,119.00	85,819,500	
ホギメディカル	24,600	3,300.00	81,180,000	
ＴＳＩホールディングス	60,700	344.00	20,880,800	
マツオカコーポレーション	5,900	942.00	5,557,800	
ワールド	26,000	1,298.00	33,748,000	
三陽商会	8,700	864.00	7,516,800	
ナイガイ	7,500	280.00	2,100,000	
オンワードホールディングス	109,700	252.00	27,644,400	
ルックホールディングス	6,400	1,641.00	10,502,400	
ゴールドウイン	32,700	8,000.00	261,600,000	
デサント	33,800	3,180.00	107,484,000	

キング	9,700	510.00	4,947,000	
ヤマトインターナショナル	15,500	283.00	4,386,500	
特種東海製紙	10,300	3,115.00	32,084,500	
王子ホールディングス	762,300	571.00	435,273,300	
日本製紙	80,100	985.00	78,898,500	
三菱製紙	25,200	298.00	7,509,600	
北越コーポレーション	117,800	729.00	85,876,200	
中越パルプ工業	7,500	929.00	6,967,500	
巴川製紙所	5,900	622.00	3,669,800	
大王製紙	84,700	1,456.00	123,323,200	
阿波製紙	4,500	301.00	1,354,500	
レンゴー	152,800	746.00	113,988,800	
トーモク	9,700	1,540.00	14,938,000	
ザ・パック	12,500	2,407.00	30,087,500	
北の達人コーポレーション	70,700	215.00	15,200,500	
クラレ	266,700	1,081.00	288,302,700	
旭化成	1,222,100	1,069.00	1,306,424,900	
共和レザー	10,700	573.00	6,131,100	
昭和電工	173,700	2,253.00	391,346,100	
住友化学	1,347,700	527.00	710,237,900	
住友精化	7,900	2,908.00	22,973,200	
日産化学	88,900	6,570.00	584,073,000	
ラサ工業	7,000	1,844.00	12,908,000	
クレハ	14,300	10,350.00	148,005,000	
多木化学	6,500	4,645.00	30,192,500	
テイカ	11,300	1,242.00	14,034,600	
石原産業	35,400	1,044.00	36,957,600	
片倉コープアグリ	4,500	1,283.00	5,773,500	
日本曹達	21,700	4,270.00	92,659,000	
東ソー	244,300	1,727.00	421,906,100	
トクヤマ	58,700	1,774.00	104,133,800	
セントラル硝子	29,600	3,145.00	93,092,000	
東亞合成	94,100	1,061.00	99,840,100	
大阪ソーダ	15,100	3,300.00	49,830,000	
関東電化工業	36,000	887.00	31,932,000	
デンカ	66,500	3,355.00	223,107,500	
信越化学工業	313,100	16,175.00	5,064,392,500	
日本カーバイド工業	7,100	1,370.00	9,727,000	
堺化学工業	12,800	1,894.00	24,243,200	
第一稀元素化学工業	16,800	1,227.00	20,613,600	
エア・ウォーター	158,300	1,722.00	272,592,600	
日本酸素ホールディングス	162,700	2,221.00	361,356,700	

日本化学工業	5,600	1,952.00	10,931,200	
東邦アセチレン	3,900	1,114.00	4,344,600	
日本パーカライジング	83,000	954.00	79,182,000	
高圧ガス工業	27,800	688.00	19,126,400	
チタン工業	2,300	1,632.00	3,753,600	
四国化成工業	22,800	1,261.00	28,750,800	
戸田工業	4,200	2,309.00	9,697,800	
ステラ　ケミファ	9,900	2,463.00	24,383,700	
保土谷化学工業	5,300	3,330.00	17,649,000	
日本触媒	28,100	5,310.00	149,211,000	
大日精化工業	14,000	1,822.00	25,508,000	
カネカ	42,600	3,410.00	145,266,000	
三菱瓦斯化学	155,500	1,975.00	307,112,500	
三井化学	153,800	2,875.00	442,175,000	
ＪＳＲ	184,100	3,555.00	654,475,500	
東京応化工業	29,300	6,790.00	198,947,000	
大阪有機化学工業	14,000	2,443.00	34,202,000	
三菱ケミカルグループ	1,226,200	752.10	922,225,020	
ＫＨネオケム	30,200	2,473.00	74,684,600	
ダイセル	265,600	848.00	225,228,800	
住友ベークライト	27,900	4,165.00	116,203,500	
積水化学工業	377,300	1,910.00	720,643,000	
日本ゼオン	148,500	1,367.00	202,999,500	
アイカ工業	46,600	3,005.00	140,033,000	
ＵＢＥ	93,100	2,042.00	190,110,200	
積水樹脂	27,100	1,765.00	47,831,500	
タキロンシーアイ	42,700	551.00	23,527,700	
旭有機材	11,200	1,981.00	22,187,200	
ニチバン	10,400	1,639.00	17,045,600	
リケンテクノス	40,100	445.00	17,844,500	
大倉工業	8,600	1,727.00	14,852,200	
積水化成品工業	23,500	418.00	9,823,000	
群栄化学工業	3,900	2,615.00	10,198,500	
タイガースポリマー	9,400	428.00	4,023,200	
ミライアル	6,300	1,811.00	11,409,300	
ダイキアクシス	7,700	706.00	5,436,200	
ダイキョーニシカワ	41,600	538.00	22,380,800	
竹本容器	7,100	793.00	5,630,300	
森六ホールディングス	9,600	1,839.00	17,654,400	
恵和	5,400	3,400.00	18,360,000	
日本化薬	138,800	1,115.00	154,762,000	
カーリットホールディングス	16,600	683.00	11,337,800	

日本精化	12,700	1,977.00	25,107,900	
扶桑化学工業	15,600	3,520.00	54,912,000	
トリケミカル研究所	20,400	2,141.00	43,676,400	
ＡＤＥＫＡ	78,000	2,317.00	180,726,000	
日油	57,100	5,180.00	295,778,000	
新日本理化	28,000	267.00	7,476,000	
ハリマ化成グループ	13,100	760.00	9,956,000	
花王	416,400	5,760.00	2,398,464,000	
第一工業製薬	6,700	2,366.00	15,852,200	
石原ケミカル	9,200	1,301.00	11,969,200	
日華化学	6,700	827.00	5,540,900	
ニイタカ	3,700	2,157.00	7,980,900	
三洋化成工業	11,800	4,775.00	56,345,000	
有機合成薬品工業	13,800	268.00	3,698,400	
大日本塗料	22,300	719.00	16,033,700	
日本ペイントホールディングス	742,200	1,114.00	826,810,800	
関西ペイント	170,700	1,878.00	320,574,600	
神東塗料	15,500	149.00	2,309,500	
中国塗料	42,700	901.00	38,472,700	
日本特殊塗料	11,800	987.00	11,646,600	
藤倉化成	24,600	483.00	11,881,800	
太陽ホールディングス	29,100	2,817.00	81,974,700	
ＤＩＣ	71,500	2,448.00	175,032,000	
サカタインクス	33,900	969.00	32,849,100	
東洋インキＳＣホールディングス	36,500	1,927.00	70,335,500	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	15,900	845.00	13,435,500	
富士フイルムホールディングス	354,500	7,580.00	2,687,110,000	
資生堂	375,700	5,616.00	2,109,931,200	
ライオン	201,500	1,532.00	308,698,000	
高砂香料工業	11,400	2,547.00	29,035,800	
マンダム	39,300	1,695.00	66,613,500	
ミルボン	24,900	5,150.00	128,235,000	
ファンケル	81,600	2,560.00	208,896,000	
コーセー	37,900	12,600.00	477,540,000	
コタ	14,100	1,601.00	22,574,100	
シーボン	2,600	1,705.00	4,433,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	86,100	1,656.00	142,581,600	
ノエビアホールディングス	15,000	5,980.00	89,700,000	
アジュバンホールディングス	4,500	996.00	4,482,000	
新日本製薬	9,600	1,611.00	15,465,600	
エステー	13,000	1,570.00	20,410,000	
アグロ　カネショウ	6,700	1,270.00	8,509,000	

コニシ	30,600	1,597.00	48,868,200	
長谷川香料	34,800	3,010.00	104,748,000	
星光ＰＭＣ	11,400	534.00	6,087,600	
小林製薬	56,500	9,050.00	511,325,000	
荒川化学工業	14,200	995.00	14,129,000	
メック	13,800	2,276.00	31,408,800	
日本高純度化学	4,700	2,304.00	10,828,800	
タカラバイオ	52,800	1,985.00	104,808,000	
ＪＣＵ	20,700	3,525.00	72,967,500	
新田ゼラチン	11,500	610.00	7,015,000	
ＯＡＴアグリオ	8,300	1,534.00	12,732,200	
デクセリアルズ	52,500	3,535.00	185,587,500	
アース製薬	16,600	5,500.00	91,300,000	
北興化学工業	16,900	955.00	16,139,500	
大成ラミック	5,300	2,740.00	14,522,000	
クミアイ化学工業	75,100	1,075.00	80,732,500	
日本農薬	35,900	674.00	24,196,600	
アキレス	12,900	1,375.00	17,737,500	
有沢製作所	27,400	1,013.00	27,756,200	
日東電工	121,900	8,720.00	1,062,968,000	
レック	23,900	687.00	16,419,300	
三光合成	23,100	339.00	7,830,900	
きもと	30,900	226.00	6,983,400	
藤森工業	15,700	3,550.00	55,735,000	
前澤化成工業	11,800	1,309.00	15,446,200	
未来工業	7,200	1,518.00	10,929,600	
ウェーブロックホールディングス	7,700	639.00	4,920,300	
ＪＳＰ	11,800	1,454.00	17,157,200	
エフピコ	37,100	2,869.00	106,439,900	
天馬	15,900	2,311.00	36,744,900	
信越ポリマー	36,200	1,216.00	44,019,200	
東リ	46,000	206.00	9,476,000	
ニフコ	67,300	3,285.00	221,080,500	
バルカー	16,400	2,600.00	42,640,000	
ユニ・チャーム	388,800	4,878.00	1,896,566,400	
ショーエイコーポレーション	5,400	586.00	3,164,400	
協和キリン	202,900	3,165.00	642,178,500	
武田薬品工業	1,585,300	3,973.00	6,298,396,900	
アステラス製薬	1,724,500	2,164.00	3,731,818,000	
住友ファーマ	124,600	1,122.00	139,801,200	
塩野義製薬	234,100	7,215.00	1,689,031,500	
わかもと製薬	19,600	264.00	5,174,400	

日本新薬	44,000	8,460.00	372,240,000	
中外製薬	630,900	3,737.00	2,357,673,300	
科研製薬	28,800	3,995.00	115,056,000	
エーザイ	222,900	6,181.00	1,377,744,900	
ロート製薬	96,100	4,020.00	386,322,000	
小野薬品工業	388,800	3,835.00	1,491,048,000	
久光製薬	42,700	3,465.00	147,955,500	
持田製薬	22,600	3,400.00	76,840,000	
参天製薬	351,300	1,104.00	387,835,200	
扶桑薬品工業	6,500	2,169.00	14,098,500	
日本ケミファ	2,100	1,880.00	3,948,000	
ツムラ	57,700	3,220.00	185,794,000	
日医工	57,200	369.00	21,106,800	
キッセイ薬品工業	29,200	2,766.00	80,767,200	
生化学工業	35,600	883.00	31,434,800	
栄研化学	30,000	1,877.00	56,310,000	
日水製薬	7,400	1,713.00	12,676,200	
鳥居薬品	10,800	3,405.00	36,774,000	
ＪＣＲファーマ	56,800	2,516.00	142,908,800	
東和薬品	29,000	2,685.00	77,865,000	
富士製薬工業	10,900	1,003.00	10,932,700	
ゼリア新薬工業	29,900	2,227.00	66,587,300	
第一三共	1,463,100	3,596.00	5,261,307,600	
キョーリン製薬ホールディングス	36,400	1,851.00	67,376,400	
大幸薬品	30,400	597.00	18,148,800	
ダイト	12,500	2,868.00	35,850,000	
大塚ホールディングス	384,300	4,984.00	1,915,351,200	
大正製薬ホールディングス	37,300	5,540.00	206,642,000	
ペプチドリーム	105,800	1,556.00	164,624,800	
あすか製薬ホールディングス	19,100	1,062.00	20,284,200	
サワイグループホールディングス	38,700	4,330.00	167,571,000	
日本コークス工業	170,400	119.00	20,277,600	
ニチレキ	21,800	1,336.00	29,124,800	
ユシロ化学工業	9,600	915.00	8,784,000	
ビーピー・カストロール	7,200	1,124.00	8,092,800	
富士石油	44,100	313.00	13,803,300	
ＭＯＲＥＳＣＯ	6,700	1,221.00	8,180,700	
出光興産	205,200	3,235.00	663,822,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	3,034,300	506.00	1,535,355,800	
コスモエネルギーホールディングス	79,600	3,515.00	279,794,000	
横浜ゴム	95,600	1,937.00	185,177,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	96,500	1,766.00	170,419,000	

ブリヂストン	536,300	5,038.00	2,701,879,400	
住友ゴム工業	164,700	1,232.00	202,910,400	
藤倉コンポジット	16,200	844.00	13,672,800	
オカモト	9,300	3,890.00	36,177,000	
フコク	8,800	960.00	8,448,000	
ニッタ	19,000	2,788.00	52,972,000	
住友理工	39,100	595.00	23,264,500	
三ツ星ベルト	24,500	2,866.00	70,217,000	
バンドー化学	32,500	962.00	31,265,000	
日東紡績	25,100	2,299.00	57,704,900	
ＡＧＣ	170,900	4,780.00	816,902,000	
日本板硝子	91,200	394.00	35,932,800	
石塚硝子	3,200	1,639.00	5,244,800	
日本山村硝子	7,200	710.00	5,112,000	
日本電気硝子	74,800	2,650.00	198,220,000	
オハラ	8,100	1,195.00	9,679,500	
住友大阪セメント	30,100	3,585.00	107,908,500	
太平洋セメント	114,700	2,007.00	230,202,900	
日本ヒューム	16,800	665.00	11,172,000	
日本コンクリート工業	36,700	271.00	9,945,700	
三谷セキサン	8,200	4,265.00	34,973,000	
アジアパイルホールディングス	28,900	479.00	13,843,100	
東海カーボン	155,100	1,044.00	161,924,400	
日本カーボン	10,400	4,060.00	42,224,000	
東洋炭素	11,900	2,933.00	34,902,700	
ノリタケカンパニーリミテド	10,300	4,200.00	43,260,000	
ＴＯＴＯ	121,900	4,585.00	558,911,500	
日本碍子	198,700	1,850.00	367,595,000	
日本特殊陶業	140,700	2,459.00	345,981,300	
ＭＡＲＵＷＡ	7,000	15,320.00	107,240,000	
品川リフラクトリーズ	4,800	3,590.00	17,232,000	
黒崎播磨	3,500	4,410.00	15,435,000	
ヨータイ	12,900	1,502.00	19,375,800	
東京窯業	20,500	276.00	5,658,000	
ニッカトー	8,700	455.00	3,958,500	
フジミインコーポレーテッド	16,200	5,510.00	89,262,000	
クニミネ工業	6,500	935.00	6,077,500	
エーアンドエーマテリアル	3,400	858.00	2,917,200	
ニチアス	42,500	2,310.00	98,175,000	
ニチハ	25,800	2,671.00	68,911,800	
日本製鉄	833,200	1,952.50	1,626,823,000	
神戸製鋼所	347,600	620.00	215,512,000	

中山製鋼所	27,800	430.00	11,954,000	
合同製鐵	9,700	1,383.00	13,415,100	
ＪＦＥホールディングス	461,800	1,481.00	683,925,800	
東京製鐵	58,300	1,469.00	85,642,700	
共英製鋼	19,700	1,408.00	27,737,600	
大和工業	32,600	4,435.00	144,581,000	
東京鐵鋼	8,300	1,267.00	10,516,100	
大阪製鐵	10,600	1,511.00	16,016,600	
淀川製鋼所	21,800	2,370.00	51,666,000	
丸一鋼管	57,900	2,898.00	167,794,200	
モリ工業	4,900	2,450.00	12,005,000	
大同特殊鋼	27,200	3,630.00	98,736,000	
日本高周波鋼業	7,600	322.00	2,447,200	
日本冶金工業	13,600	2,196.00	29,865,600	
山陽特殊製鋼	17,100	1,894.00	32,387,400	
愛知製鋼	11,200	2,097.00	23,486,400	
日立金属	214,900	2,059.00	442,479,100	
日本金属	5,000	1,145.00	5,725,000	
大平洋金属	12,300	2,361.00	29,040,300	
新日本電工	110,600	352.00	38,931,200	
栗本鐵工所	8,200	1,696.00	13,907,200	
虹技	2,600	978.00	2,542,800	
三菱製鋼	12,900	950.00	12,255,000	
日亜鋼業	23,000	259.00	5,957,000	
日本精線	3,100	4,430.00	13,733,000	
エンビプロ・ホールディングス	13,300	778.00	10,347,400	
シンニッタン	24,400	224.00	5,465,600	
新家工業	4,200	1,460.00	6,132,000	
大紀アルミニウム工業所	24,700	1,201.00	29,664,700	
日本軽金属ホールディングス	50,500	1,528.00	77,164,000	
三井金属鉱業	53,900	3,090.00	166,551,000	
東邦亜鉛	10,300	2,179.00	22,443,700	
三菱マテリアル	115,300	1,945.00	224,258,500	
住友金属鉱山	218,600	4,065.00	888,609,000	
ＤＯＷＡホールディングス	46,600	4,560.00	212,496,000	
古河機械金属	30,500	1,218.00	37,149,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,100	3,050.00	70,455,000	
東邦チタニウム	35,700	2,325.00	83,002,500	
ＵＡＣＪ	27,300	2,089.00	57,029,700	
ＣＫサンエツ	3,800	4,270.00	16,226,000	
古河電気工業	57,600	2,284.00	131,558,400	
住友電気工業	696,100	1,486.00	1,034,404,600	

フジクラ	222,500	743.00	165,317,500	
昭和電線ホールディングス	17,400	1,582.00	27,526,800	
東京特殊電線	2,600	2,309.00	6,003,400	
タツタ電線	35,400	462.00	16,354,800	
カナレ電気	3,000	1,544.00	4,632,000	
平河ヒューテック	11,100	1,088.00	12,076,800	
リョービ	20,500	1,049.00	21,504,500	
アーレスティ	21,500	376.00	8,084,000	
アサヒホールディングス	79,900	2,091.00	167,070,900	
稲葉製作所	10,100	1,381.00	13,948,100	
宮地エンジニアリンググループ	5,600	3,340.00	18,704,000	
トーカロ	51,400	1,259.00	64,712,600	
アルファＣｏ	7,000	1,007.00	7,049,000	
ＳＵＭＣＯ	328,900	1,762.00	579,521,800	
川田テクノロジーズ	3,700	3,660.00	13,542,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	6,500	6,030.00	39,195,000	
ジェイテックコーポレーション	2,600	2,144.00	5,574,400	
信和	12,400	783.00	9,709,200	
東洋製罐グループホールディングス	101,600	1,419.00	144,170,400	
ホッカンホールディングス	9,300	1,263.00	11,745,900	
コロナ	9,600	847.00	8,131,200	
横河ブリッジホールディングス	28,500	1,956.00	55,746,000	
駒井ハルテック	3,100	1,707.00	5,291,700	
高田機工	1,700	2,428.00	4,127,600	
三和ホールディングス	188,100	1,335.00	251,113,500	
文化シヤッター	58,800	1,017.00	59,799,600	
三協立山	23,700	551.00	13,058,700	
アルインコ	13,200	866.00	11,431,200	
東洋シヤッター	4,400	571.00	2,512,400	
ＬＩＸＩＬ	313,900	2,710.00	850,669,000	
日本フイルコン	12,500	495.00	6,187,500	
ノーリツ	31,800	1,489.00	47,350,200	
長府製作所	20,300	1,803.00	36,600,900	
リンナイ	34,500	9,800.00	338,100,000	
ダイニチ工業	9,500	659.00	6,260,500	
日東精工	22,500	495.00	11,137,500	
三洋工業	2,400	1,788.00	4,291,200	
岡部	30,900	620.00	19,158,000	
ジーテクト	22,000	1,300.00	28,600,000	
東プレ	30,400	1,046.00	31,798,400	
高周波熱錬	30,700	672.00	20,630,400	
東京製綱	12,200	941.00	11,480,200	

サンコール	17,100	616.00	10,533,600	
モリテック　スチール	15,500	281.00	4,355,500	
パイオラックス	26,200	1,984.00	51,980,800	
エイチワン	17,800	612.00	10,893,600	
日本発條	168,100	879.00	147,759,900	
中央発條	9,600	706.00	6,777,600	
アドバネクス	2,600	1,167.00	3,034,200	
立川ブラインド工業	7,800	1,080.00	8,424,000	
三益半導体工業	15,600	2,056.00	32,073,600	
日本ドライケミカル	4,600	1,648.00	7,580,800	
日本製鋼所	51,300	3,125.00	160,312,500	
三浦工業	78,600	3,150.00	247,590,000	
タクマ	57,400	1,322.00	75,882,800	
ツガミ	41,000	1,144.00	46,904,000	
オークマ	19,100	5,170.00	98,747,000	
芝浦機械	22,600	2,710.00	61,246,000	
アマダ	315,100	1,018.00	320,771,800	
アイダエンジニアリング	43,800	927.00	40,602,600	
滝澤鉄工所	5,900	1,198.00	7,068,200	
ＦＵＪＩ	79,700	2,034.00	162,109,800	
牧野フライス製作所	20,300	4,340.00	88,102,000	
オーエスジー	87,100	1,639.00	142,756,900	
ダイジェット工業	2,400	908.00	2,179,200	
旭ダイヤモンド工業	49,300	624.00	30,763,200	
DMG森精機	110,600	1,682.00	186,029,200	
ソディック	43,600	821.00	35,795,600	
ディスコ	29,400	30,650.00	901,110,000	
日東工器	9,600	1,559.00	14,966,400	
日進工具	15,800	1,287.00	20,334,600	
パンチ工業	17,100	451.00	7,712,100	
冨士ダイス	10,200	657.00	6,701,400	
豊和工業	10,600	914.00	9,688,400	
ニデックオーケーケー	7,500	1,180.00	8,850,000	
東洋機械金属	13,200	569.00	7,510,800	
津田駒工業	3,400	502.00	1,706,800	
エンシュウ	4,700	917.00	4,309,900	
島精機製作所	29,300	2,170.00	63,581,000	
オプトラン	25,100	1,885.00	47,313,500	
ＮＣホールディングス	5,600	2,137.00	11,967,200	
イワキポンプ	12,800	976.00	12,492,800	
フリュー	17,800	1,132.00	20,149,600	
ヤマシンフィルタ	31,700	329.00	10,429,300	

日阪製作所	20,600	847.00	17,448,200	
やまびこ	33,200	1,168.00	38,777,600	
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,480.00	22,272,000	
平田機工	8,800	4,445.00	39,116,000	
ペガサスミシン製造	20,400	601.00	12,260,400	
マルマエ	8,200	1,916.00	15,711,200	
タツモ	10,300	1,246.00	12,833,800	
ナブテスコ	106,200	3,265.00	346,743,000	
三井海洋開発	21,300	1,164.00	24,793,200	
レオン自動機	21,400	1,316.00	28,162,400	
ＳＭＣ	59,100	62,400.00	3,687,840,000	
ホソカワミクロン	13,000	2,742.00	35,646,000	
ユニオンツール	7,500	3,245.00	24,337,500	
オイレス工業	25,900	1,585.00	41,051,500	
日精エー・エス・ビー機械	7,700	3,560.00	27,412,000	
サトーホールディングス	26,300	1,935.00	50,890,500	
技研製作所	17,700	3,165.00	56,020,500	
日本エアーテック	9,300	1,027.00	9,551,100	
カワタ	6,000	976.00	5,856,000	
日精樹脂工業	12,900	914.00	11,790,600	
オカダアイヨン	6,400	1,485.00	9,504,000	
ワイエイシイホールディングス	7,900	1,496.00	11,818,400	
小松製作所	914,200	2,963.00	2,708,774,600	
住友重機械工業	107,900	2,951.00	318,412,900	
日立建機	80,900	2,877.00	232,749,300	
日工	25,500	639.00	16,294,500	
巴工業	7,300	2,365.00	17,264,500	
井関農機	16,100	1,204.00	19,384,400	
ＴＯＷＡ	17,300	1,731.00	29,946,300	
丸山製作所	3,400	1,563.00	5,314,200	
北川鉄工所	8,100	1,433.00	11,607,300	
ローツェ	10,000	8,630.00	86,300,000	
タカキタ	6,400	512.00	3,276,800	
クボタ	977,200	2,140.00	2,091,208,000	
荏原実業	9,400	2,292.00	21,544,800	
三菱化工機	6,100	2,070.00	12,627,000	
月島機械	31,800	888.00	28,238,400	
帝国電機製作所	12,900	1,675.00	21,607,500	
新東工業	38,000	705.00	26,790,000	
澁谷工業	16,000	2,444.00	39,104,000	
アイチ　コーポレーション	29,100	844.00	24,560,400	
小森コーポレーション	46,700	817.00	38,153,900	

鶴見製作所	14,400	1,945.00	28,008,000	
住友精密工業	3,000	2,832.00	8,496,000	
日本ギア工業	7,600	302.00	2,295,200	
酒井重工業	3,400	2,906.00	9,880,400	
荏原製作所	80,700	5,100.00	411,570,000	
石井鐵工所	2,500	2,942.00	7,355,000	
酉島製作所	16,600	1,314.00	21,812,400	
北越工業	17,100	900.00	15,390,000	
ダイキン工業	220,300	22,095.00	4,867,528,500	
オルガノ	5,800	8,650.00	50,170,000	
トーヨーカネツ	7,100	2,706.00	19,212,600	
栗田工業	101,900	5,040.00	513,576,000	
椿本チエイン	26,500	3,085.00	81,752,500	
大同工業	8,600	816.00	7,017,600	
木村化工機	15,900	746.00	11,861,400	
アネスト岩田	31,500	911.00	28,696,500	
ダイフク	95,200	8,240.00	784,448,000	
サムコ	5,600	2,725.00	15,260,000	
加藤製作所	9,900	806.00	7,979,400	
油研工業	3,300	1,774.00	5,854,200	
タダノ	97,700	954.00	93,205,800	
フジテック	62,000	3,030.00	187,860,000	
ＣＫＤ	51,100	1,753.00	89,578,300	
キトー	15,900	2,629.00	41,801,100	
平和	56,300	2,061.00	116,034,300	
理想科学工業	17,000	2,312.00	39,304,000	
ＳＡＮＫＹＯ	41,600	4,205.00	174,928,000	
日本金銭機械	20,600	685.00	14,111,000	
マースグループホールディングス	12,900	1,636.00	21,104,400	
フクシマガリレイ	12,500	3,585.00	44,812,500	
オーイズミ	7,300	407.00	2,971,100	
ダイコク電機	9,400	1,261.00	11,853,400	
竹内製作所	30,700	2,344.00	71,960,800	
アマノ	52,900	2,478.00	131,086,200	
ＪＵＫＩ	28,100	716.00	20,119,600	
ジャノメ	17,300	720.00	12,456,000	
マックス	23,900	1,657.00	39,602,300	
グローリー	47,900	2,150.00	102,985,000	
新晃工業	18,800	1,683.00	31,640,400	
大和冷機工業	29,300	1,117.00	32,728,100	
セガサミーホールディングス	181,300	2,256.00	409,012,800	
日本ピストンリング	7,400	1,273.00	9,420,200	

リケン	7,400	2,371.00	17,545,400	
ＴＰＲ	22,100	1,224.00	27,050,400	
ツバキ・ナカシマ	44,400	910.00	40,404,000	
ホシザキ	118,000	4,030.00	475,540,000	
大豊工業	16,600	675.00	11,205,000	
日本精工	345,400	734.00	253,523,600	
ＮＴＮ	366,800	256.00	93,900,800	
ジェイテクト	172,100	1,020.00	175,542,000	
不二越	14,100	3,635.00	51,253,500	
日本トムソン	46,300	520.00	24,076,000	
ＴＨＫ	113,900	2,695.00	306,960,500	
ユーシン精機	15,800	712.00	11,249,600	
前澤給装工業	13,100	923.00	12,091,300	
イーグル工業	21,900	1,001.00	21,921,900	
前澤工業	12,300	616.00	7,576,800	
日本ピラー工業	17,300	2,631.00	45,516,300	
キッツ	56,800	674.00	38,283,200	
マキタ	228,000	3,440.00	784,320,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	74,200	340.00	25,228,000	
日立造船	160,300	834.00	133,690,200	
三菱重工業	295,800	5,053.00	1,494,677,400	
ＩＨＩ	126,000	3,605.00	454,230,000	
スター精密	27,300	1,641.00	44,799,300	
日清紡ホールディングス	116,400	1,053.00	122,569,200	
イビデン	97,500	3,885.00	378,787,500	
コニカミノルタ	413,300	460.00	190,118,000	
ブラザー工業	230,700	2,413.00	556,679,100	
ミネベアミツミ	321,700	2,330.00	749,561,000	
日立製作所	970,100	6,565.00	6,368,706,500	
東芝	352,600	5,470.00	1,928,722,000	
三菱電機	1,882,400	1,469.00	2,765,245,600	
富士電機	112,200	5,500.00	617,100,000	
東洋電機製造	6,700	900.00	6,030,000	
安川電機	200,400	4,290.00	859,716,000	
シンフォニアテクノロジー	20,500	1,382.00	28,331,000	
明電舎	28,500	2,052.00	58,482,000	
オリジン	4,600	1,198.00	5,510,800	
山洋電気	7,700	5,250.00	40,425,000	
デンヨー	14,300	1,643.00	23,494,900	
ＰＨＣホールディングス	32,700	1,446.00	47,284,200	
東芝テック	21,700	4,450.00	96,565,000	
芝浦メカトロニクス	3,800	9,280.00	35,264,000	

マブチモーター	46,700	3,685.00	172,089,500	
日本電産	448,300	9,112.00	4,084,909,600	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,800	446.00	5,262,800	
トレックス・セミコンダクター	9,500	2,454.00	23,313,000	
東光高岳	12,400	1,793.00	22,233,200	
ダイヘン	18,700	4,010.00	74,987,000	
ヤーマン	34,100	1,698.00	57,901,800	
ＪＶＣケンウッド	175,900	180.00	31,662,000	
ミマキエンジニアリング	22,000	557.00	12,254,000	
Ｉ－ＰＥＸ	11,000	1,343.00	14,773,000	
日新電機	47,300	1,471.00	69,578,300	
大崎電気工業	33,900	506.00	17,153,400	
オムロン	167,900	7,027.00	1,179,833,300	
日東工業	25,300	2,351.00	59,480,300	
ＩＤＥＣ	25,000	2,805.00	70,125,000	
正興電機製作所	7,500	1,130.00	8,475,000	
不二電機工業	5,500	1,156.00	6,358,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	61,500	2,208.00	135,792,000	
サクサホールディングス	4,700	1,243.00	5,842,100	
メルコホールディングス	6,200	3,580.00	22,196,000	
テクノメディカ	5,800	1,585.00	9,193,000	
日本電気	239,200	5,500.00	1,315,600,000	
富士通	181,500	18,145.00	3,293,317,500	
沖電気工業	76,500	755.00	57,757,500	
岩崎通信機	8,200	805.00	6,601,000	
電気興業	9,700	2,507.00	24,317,900	
サンケン電気	17,300	4,695.00	81,223,500	
ナカヨ	3,300	1,130.00	3,729,000	
アイホン	9,100	1,822.00	16,580,200	
ルネサスエレクトロニクス	1,099,800	1,235.00	1,358,253,000	
セイコーエプソン	225,200	1,978.00	445,445,600	
ワコム	156,900	851.00	133,521,900	
アルバック	40,200	4,730.00	190,146,000	
アクセル	10,400	797.00	8,288,800	
ＥＩＺＯ	13,800	3,835.00	52,923,000	
日本信号	42,800	996.00	42,628,800	
京三製作所	39,400	445.00	17,533,000	
能美防災	24,000	1,873.00	44,952,000	
ホーチキ	14,200	1,306.00	18,545,200	
星和電機	12,400	462.00	5,728,800	
エレコム	47,500	1,624.00	77,140,000	
パナソニック　ホールディングス	2,151,300	1,140.00	2,452,482,000	

シャープ	191,600	1,072.00	205,395,200	
アンリツ	129,900	1,534.00	199,266,600	
富士通ゼネラル	54,800	2,765.00	151,522,000	
ソニーグループ	1,263,500	11,380.00	14,378,630,000	
ＴＤＫ	292,600	4,085.00	1,195,271,000	
帝国通信工業	10,400	1,419.00	14,757,600	
タムラ製作所	72,600	582.00	42,253,200	
アルプスアルパイン	166,200	1,316.00	218,719,200	
池上通信機	5,900	600.00	3,540,000	
日本電波工業	22,100	1,101.00	24,332,100	
鈴木	12,600	787.00	9,916,200	
メイコー	22,400	3,110.00	69,664,000	
日本トリム	4,600	2,505.00	11,523,000	
ローランド　ディー．ジー．	12,500	3,150.00	39,375,000	
フォスター電機	18,800	764.00	14,363,200	
ＳＭＫ	4,700	2,147.00	10,090,900	
ヨコオ	14,400	1,999.00	28,785,600	
ホシデン	46,200	1,255.00	57,981,000	
ヒロセ電機	28,000	18,690.00	523,320,000	
日本航空電子工業	40,500	2,086.00	84,483,000	
ＴＯＡ	21,600	782.00	16,891,200	
マクセル	38,300	1,347.00	51,590,100	
古野電気	26,000	1,067.00	27,742,000	
ユニデンホールディングス	4,400	4,100.00	18,040,000	
スミダコーポレーション	21,500	799.00	17,178,500	
アイコム	6,500	2,540.00	16,510,000	
リオン	7,800	2,447.00	19,086,600	
本多通信工業	19,600	531.00	10,407,600	
横河電機	185,000	2,244.00	415,140,000	
新電元工業	7,100	3,435.00	24,388,500	
アズビル	117,000	3,775.00	441,675,000	
東亜ディーケーケー	12,400	907.00	11,246,800	
日本光電工業	78,400	3,025.00	237,160,000	
チノー	6,400	1,688.00	10,803,200	
共和電業	19,300	317.00	6,118,100	
日本電子材料	9,500	1,626.00	15,447,000	
堀場製作所	34,600	6,100.00	211,060,000	
アドバンテスト	149,900	7,260.00	1,088,274,000	
小野測器	12,500	424.00	5,300,000	
エスペック	16,100	1,826.00	29,398,600	
キーエンス	182,800	50,260.00	9,187,528,000	
日置電機	10,000	6,570.00	65,700,000	

シスメックス	144,600	9,063.00	1,310,509,800	
日本マイクロニクス	31,700	1,238.00	39,244,600	
メガチップス	18,500	3,085.00	57,072,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8,600	3,030.00	26,058,000	
澤藤電機	3,900	1,454.00	5,670,600	
原田工業	11,800	896.00	10,572,800	
コーセル	24,900	843.00	20,990,700	
イリソ電子工業	17,600	3,250.00	57,200,000	
オプテックスグループ	34,100	2,074.00	70,723,400	
千代田インテグレ	8,700	2,015.00	17,530,500	
レーザーテック	82,800	16,885.00	1,398,078,000	
スタンレー電気	130,800	2,338.00	305,810,400	
岩崎電気	7,200	2,631.00	18,943,200	
ウシオ電機	96,600	1,709.00	165,089,400	
岡谷電機産業	22,200	252.00	5,594,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	23,800	321.00	7,639,800	
エノモト	7,000	1,465.00	10,255,000	
日本セラミック	19,800	2,044.00	40,471,200	
遠藤照明	11,900	775.00	9,222,500	
古河電池	16,100	1,225.00	19,722,500	
双信電機	13,800	506.00	6,982,800	
山一電機	14,400	1,646.00	23,702,400	
図研	13,800	3,255.00	44,919,000	
日本電子	39,100	5,430.00	212,313,000	
カシオ計算機	124,800	1,264.00	157,747,200	
ファナック	177,000	21,915.00	3,878,955,000	
日本シイエムケイ	40,400	436.00	17,614,400	
エンプラス	5,600	3,100.00	17,360,000	
大真空	27,200	887.00	24,126,400	
ローム	84,100	9,430.00	793,063,000	
浜松ホトニクス	134,700	5,710.00	769,137,000	
三井ハイテック	17,500	8,390.00	146,825,000	
新光電気工業	59,800	3,425.00	204,815,000	
京セラ	284,000	7,060.00	2,005,040,000	
太陽誘電	90,100	4,560.00	410,856,000	
村田製作所	550,400	7,638.00	4,203,955,200	
双葉電子工業	37,600	690.00	25,944,000	
北陸電気工業	9,400	1,109.00	10,424,600	
ニチコン	55,300	1,214.00	67,134,200	
日本ケミコン	20,300	1,690.00	34,307,000	
ＫＯＡ	29,100	1,606.00	46,734,600	
市光工業	30,100	375.00	11,287,500	

小糸製作所	101,100	4,530.00	457,983,000	
ミツバ	31,400	413.00	12,968,200	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	31,800	8,950.00	284,610,000	
キヤノン電子	19,800	1,556.00	30,808,800	
キヤノン	1,002,300	3,173.00	3,180,297,900	
リコー	479,900	1,067.00	512,053,300	
象印マホービン	51,500	1,515.00	78,022,500	
ＭＵＴＯＨホールディングス	3,500	2,025.00	7,087,500	
東京エレクトロン	128,000	42,950.00	5,497,600,000	
トヨタ紡織	70,500	2,042.00	143,961,000	
芦森工業	3,800	1,025.00	3,895,000	
ユニプレス	33,100	850.00	28,135,000	
豊田自動織機	142,800	8,210.00	1,172,388,000	
モリタホールディングス	32,300	1,346.00	43,475,800	
三櫻工業	27,900	694.00	19,362,600	
デンソー	394,700	7,410.00	2,924,727,000	
東海理化電機製作所	53,100	1,486.00	78,906,600	
川崎重工業	136,700	2,510.00	343,117,000	
名村造船所	51,900	433.00	22,472,700	
日本車輌製造	6,400	2,097.00	13,420,800	
三菱ロジスネクスト	26,700	880.00	23,496,000	
近畿車輛	3,000	1,108.00	3,324,000	
日産自動車	2,378,800	517.40	1,230,791,120	
いすゞ自動車	584,200	1,478.00	863,447,600	
トヨタ自動車	9,195,000	2,152.00	19,787,640,000	
日野自動車	251,900	713.00	179,604,700	
三菱自動車工業	746,600	436.00	325,517,600	
エフテック	12,900	506.00	6,527,400	
レシップホールディングス	8,000	531.00	4,248,000	
ＧＭＢ	3,600	703.00	2,530,800	
ファルテック	3,500	603.00	2,110,500	
武蔵精密工業	45,000	1,398.00	62,910,000	
日産車体	29,500	594.00	17,523,000	
新明和工業	52,600	1,070.00	56,282,000	
極東開発工業	32,100	1,436.00	46,095,600	
トピー工業	15,100	1,322.00	19,962,200	
ティラド	5,500	2,577.00	14,173,500	
曙ブレーキ工業	110,700	159.00	17,601,300	
タチエス	33,100	1,100.00	36,410,000	
ＮＯＫ	75,900	1,162.00	88,195,800	
フタバ産業	44,900	388.00	17,421,200	
ＫＹＢ	17,700	3,080.00	54,516,000	

大同メタル工業	38,700	534.00	20,665,800	
プレス工業	90,400	403.00	36,431,200	
ミクニ	23,500	362.00	8,507,000	
太平洋工業	38,400	1,081.00	41,510,400	
河西工業	24,700	269.00	6,644,300	
アイシン	147,600	4,225.00	623,610,000	
マツダ	593,500	1,042.00	618,427,000	
今仙電機製作所	13,200	601.00	7,933,200	
本田技研工業	1,474,600	3,313.00	4,885,349,800	
スズキ	399,800	4,290.00	1,715,142,000	
ＳＵＢＡＲＵ	529,800	2,304.50	1,220,924,100	
安永	8,100	724.00	5,864,400	
ヤマハ発動機	263,200	2,547.00	670,370,400	
ＴＢＫ	20,300	339.00	6,881,700	
エクセディ	30,400	1,745.00	53,048,000	
豊田合成	57,000	2,159.00	123,063,000	
愛三工業	31,600	715.00	22,594,000	
盟和産業	2,900	1,003.00	2,908,700	
日本プラスト	14,600	461.00	6,730,600	
ヨロズ	15,700	901.00	14,145,700	
エフ・シー・シー	33,000	1,362.00	44,946,000	
シマノ	74,200	23,380.00	1,734,796,000	
テイ・エス　テック	85,200	1,460.00	124,392,000	
ジャムコ	11,800	1,130.00	13,334,000	
テルモ	570,800	4,258.00	2,430,466,400	
クリエートメディック	6,100	989.00	6,032,900	
日機装	51,200	817.00	41,830,400	
日本エム・ディ・エム	11,600	1,608.00	18,652,800	
島津製作所	241,000	4,475.00	1,078,475,000	
ＪＭＳ	15,600	553.00	8,626,800	
長野計器	13,400	1,126.00	15,088,400	
ブイ・テクノロジー	8,800	2,874.00	25,291,200	
東京計器	12,900	1,308.00	16,873,200	
愛知時計電機	7,300	1,421.00	10,373,300	
インターアクション	10,100	1,822.00	18,402,200	
オーバル	18,100	350.00	6,335,000	
東京精密	31,500	4,440.00	139,860,000	
マニー	73,700	1,600.00	117,920,000	
ニコン	284,300	1,448.00	411,666,400	
トプコン	94,900	1,812.00	171,958,800	
オリンパス	976,400	2,745.50	2,680,706,200	
理研計器	13,300	3,850.00	51,205,000	

タムロン	14,100	2,594.00	36,575,400	
ＨＯＹＡ	389,400	12,695.00	4,943,433,000	
シード	9,500	517.00	4,911,500	
ノーリツ鋼機	18,100	2,322.00	42,028,200	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	22,700	900.00	20,430,000	
朝日インテック	221,100	2,357.00	521,132,700	
シチズン時計	196,900	547.00	107,704,300	
リズム	6,300	1,710.00	10,773,000	
大研医器	16,000	482.00	7,712,000	
メニコン	62,200	3,215.00	199,973,000	
シンシア	2,200	419.00	921,800	
松風	6,700	1,711.00	11,463,700	
セイコーホールディングス	28,500	2,881.00	82,108,500	
ニプロ	139,600	1,117.00	155,933,200	
中本パックス	5,600	1,606.00	8,993,600	
スノーピーク	26,300	2,660.00	69,958,000	
パラマウントベッドホールディングス	38,700	2,347.00	90,828,900	
トランザクション	12,900	1,158.00	14,938,200	
粧美堂	5,000	398.00	1,990,000	
ニホンフラッシュ	15,700	946.00	14,852,200	
前田工繊	18,200	2,956.00	53,799,200	
永大産業	22,000	264.00	5,808,000	
アートネイチャー	17,200	751.00	12,917,200	
バンダイナムコホールディングス	166,800	10,040.00	1,674,672,000	
アイフィスジャパン	5,100	628.00	3,202,800	
共立印刷	27,600	147.00	4,057,200	
ＳＨＯＥＩ	17,700	5,380.00	95,226,000	
フランスベッドホールディングス	25,900	915.00	23,698,500	
パイロットコーポレーション	28,800	4,905.00	141,264,000	
萩原工業	12,100	1,129.00	13,660,900	
フジシールインターナショナル	41,400	1,481.00	61,313,400	
タカラトミー	83,300	1,439.00	119,868,700	
広済堂ホールディングス	12,500	1,064.00	13,300,000	
エステールホールディングス	4,300	631.00	2,713,300	
タカノ	6,900	830.00	5,727,000	
プロネクサス	15,600	1,108.00	17,284,800	
ホクシン	14,200	146.00	2,073,200	
ウッドワン	6,200	1,168.00	7,241,600	
大建工業	10,200	1,907.00	19,451,400	
凸版印刷	262,800	2,218.00	582,890,400	
大日本印刷	218,500	2,852.00	623,162,000	
共同印刷	5,200	2,625.00	13,650,000	

ＮＩＳＳＨＡ	35,000	1,512.00	52,920,000	
光村印刷	1,600	1,243.00	1,988,800	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	11,500	1,846.00	21,229,000	
アシックス	154,600	2,528.00	390,828,800	
ツツミ	5,000	2,052.00	10,260,000	
ローランド	14,100	4,055.00	57,175,500	
小松ウオール工業	6,100	2,002.00	12,212,200	
ヤマハ	117,300	5,630.00	660,399,000	
河合楽器製作所	5,100	2,686.00	13,698,600	
クリナップ	18,800	601.00	11,298,800	
ピジョン	121,900	1,970.00	240,143,000	
兼松サステック	1,300	1,617.00	2,102,100	
キングジム	14,800	910.00	13,468,000	
リンテック	38,400	2,331.00	89,510,400	
イトーキ	37,200	379.00	14,098,800	
任天堂	113,900	59,100.00	6,731,490,000	
三菱鉛筆	27,200	1,464.00	39,820,800	
タカラスタンダード	32,400	1,312.00	42,508,800	
コクヨ	88,700	1,768.00	156,821,600	
ナカバヤシ	16,200	503.00	8,148,600	
グローブライド	15,000	2,151.00	32,265,000	
オカムラ	56,700	1,250.00	70,875,000	
美津濃	16,600	2,409.00	39,989,400	
東京電力ホールディングス	1,509,500	619.00	934,380,500	
中部電力	569,600	1,398.00	796,300,800	
関西電力	705,400	1,375.00	969,925,000	
中国電力	290,900	902.00	262,391,800	
北陸電力	171,200	549.00	93,988,800	
東北電力	440,900	746.00	328,911,400	
四国電力	167,600	800.00	134,080,000	
九州電力	386,000	886.00	341,996,000	
北海道電力	175,300	518.00	90,805,400	
沖縄電力	42,800	1,319.00	56,453,200	
電源開発	149,000	2,279.00	339,571,000	
エフオン	12,200	579.00	7,063,800	
イーレックス	26,000	2,396.00	62,296,000	
レノバ	39,600	2,622.00	103,831,200	
東京瓦斯	359,000	2,525.00	906,475,000	
大阪瓦斯	339,200	2,411.00	817,811,200	
東邦瓦斯	79,100	2,995.00	236,904,500	
北海道瓦斯	10,000	1,601.00	16,010,000	
広島ガス	35,300	324.00	11,437,200	

西部ガスホールディングス	19,200	1,866.00	35,827,200	
静岡ガス	47,700	931.00	44,408,700	
メタウォーター	20,900	2,038.00	42,594,200	
ＳＢＳホールディングス	14,900	2,859.00	42,599,100	
東武鉄道	183,900	3,060.00	562,734,000	
相鉄ホールディングス	59,900	2,332.00	139,686,800	
東急	469,600	1,588.00	745,724,800	
京浜急行電鉄	224,500	1,438.00	322,831,000	
小田急電鉄	253,800	1,845.00	468,261,000	
京王電鉄	88,600	4,945.00	438,127,000	
京成電鉄	118,800	3,515.00	417,582,000	
富士急行	20,600	3,960.00	81,576,000	
新京成電鉄	4,700	2,867.00	13,474,900	
東日本旅客鉄道	307,700	6,693.00	2,059,436,100	
西日本旅客鉄道	213,900	4,791.00	1,024,794,900	
東海旅客鉄道	141,900	15,175.00	2,153,332,500	
西武ホールディングス	243,100	1,322.00	321,378,200	
鴻池運輸	28,500	1,287.00	36,679,500	
西日本鉄道	48,500	2,857.00	138,564,500	
ハマキョウレックス	13,100	3,055.00	40,020,500	
サカイ引越センター	9,300	4,725.00	43,942,500	
近鉄グループホールディングス	179,100	4,175.00	747,742,500	
阪急阪神ホールディングス	222,900	3,690.00	822,501,000	
南海電気鉄道	79,900	2,554.00	204,064,600	
京阪ホールディングス	74,400	3,250.00	241,800,000	
神戸電鉄	4,500	3,255.00	14,647,500	
名古屋鉄道	184,800	2,076.00	383,644,800	
山陽電気鉄道	13,600	2,147.00	29,199,200	
アルプス物流	13,300	1,159.00	15,414,700	
ヤマトホールディングス	267,700	2,274.00	608,749,800	
山九	46,400	4,030.00	186,992,000	
丸運	9,100	233.00	2,120,300	
丸全昭和運輸	12,900	3,170.00	40,893,000	
センコーグループホールディングス	88,500	907.00	80,269,500	
トナミホールディングス	3,700	3,670.00	13,579,000	
ニッコンホールディングス	57,600	2,234.00	128,678,400	
日本石油輸送	2,100	2,440.00	5,124,000	
福山通運	24,400	3,140.00	76,616,000	
セイノーホールディングス	104,000	1,117.00	116,168,000	
エスライン	5,200	849.00	4,414,800	
神奈川中央交通	4,700	3,450.00	16,215,000	
日立物流	36,900	8,550.00	315,495,000	

丸和運輸機関	32,300	1,417.00	45,769,100	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	16,100	1,125.00	18,112,500	
九州旅客鉄道	128,100	2,741.00	351,122,100	
ＳＧホールディングス	320,800	2,511.00	805,528,800	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	56,700	7,550.00	428,085,000	
日本郵船	160,100	9,300.00	1,488,930,000	
商船三井	295,700	3,100.00	916,670,000	
川崎汽船	58,800	7,860.00	462,168,000	
ＮＳユナイテッド海運	10,000	3,735.00	37,350,000	
飯野海運	80,200	686.00	55,017,200	
共栄タンカー	7,300	956.00	6,978,800	
乾汽船	11,400	1,773.00	20,212,200	
日本航空	410,600	2,283.00	937,399,800	
ＡＮＡホールディングス	454,900	2,461.50	1,119,736,350	
パスコ	3,600	1,335.00	4,806,000	
トランコム	5,300	7,450.00	39,485,000	
日新	14,000	1,615.00	22,610,000	
三菱倉庫	46,200	3,360.00	155,232,000	
三井倉庫ホールディングス	18,700	2,995.00	56,006,500	
住友倉庫	56,100	2,044.00	114,668,400	
澁澤倉庫	9,500	2,164.00	20,558,000	
東陽倉庫	27,100	291.00	7,886,100	
日本トランスシティ	33,600	497.00	16,699,200	
ケイヒン	3,300	1,348.00	4,448,400	
中央倉庫	9,800	985.00	9,653,000	
川西倉庫	3,500	1,055.00	3,692,500	
安田倉庫	12,800	935.00	11,968,000	
ファイズホールディングス	4,100	731.00	2,997,100	
東洋埠頭	5,300	1,315.00	6,969,500	
上組	90,700	2,710.00	245,797,000	
サンリツ	4,900	701.00	3,434,900	
キムラユニティー	9,900	781.00	7,731,900	
キユーソー流通システム	9,500	1,157.00	10,991,500	
東海運	10,900	283.00	3,084,700	
エーアイテイー	12,000	1,542.00	18,504,000	
内外トランスライン	7,400	1,848.00	13,675,200	
日本コンセプト	6,100	1,434.00	8,747,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	65,600	1,934.00	126,870,400	
クロスキャット	10,900	999.00	10,889,100	
システナ	282,900	451.00	127,587,900	
デジタルアーツ	10,700	6,230.00	66,661,000	
日鉄ソリューションズ	34,400	3,810.00	131,064,000	

キューブシステム	10,200	1,003.00	10,230,600	
WOW　WORLD	3,000	1,055.00	3,165,000	
コア	8,500	1,479.00	12,571,500	
手間いらず	2,900	5,240.00	15,196,000	
ラクーンホールディングス	16,900	1,632.00	27,580,800	
ソリトンシステムズ	10,100	1,268.00	12,806,800	
ソフトクリエイトホールディングス	8,700	4,125.00	35,887,500	
ＴＩＳ	173,100	3,645.00	630,949,500	
ＪＮＳホールディングス	9,100	413.00	3,758,300	
グリー	90,300	833.00	75,219,900	
GMOペパボ	2,200	2,000.00	4,400,000	
コーエーテクモホールディングス	63,200	4,705.00	297,356,000	
三菱総合研究所	8,300	4,195.00	34,818,500	
電算	2,300	2,192.00	5,041,600	
ＡＧＳ	8,100	764.00	6,188,400	
ファインデックス	17,000	672.00	11,424,000	
ブレインパッド	17,000	1,117.00	18,989,000	
ＫＬａｂ	33,900	491.00	16,644,900	
ポールトゥウィンホールディングス	28,900	947.00	27,368,300	
ネクソン	451,600	2,921.00	1,319,123,600	
アイスタイル	52,000	248.00	12,896,000	
エムアップホールディングス	23,000	1,362.00	31,326,000	
エイチーム	12,700	708.00	8,991,600	
エニグモ	21,800	522.00	11,379,600	
テクノスジャパン	15,800	485.00	7,663,000	
コロプラ	65,500	662.00	43,361,000	
ブロードリーフ	98,600	461.00	45,454,600	
クロス・マーケティンググループ	7,800	729.00	5,686,200	
デジタルハーツホールディングス	9,100	1,811.00	16,480,100	
システム情報	15,100	978.00	14,767,800	
メディアドゥ	6,900	2,052.00	14,158,800	
じげん	56,600	340.00	19,244,000	
ブイキューブ	20,300	1,202.00	24,400,600	
エンカレッジ・テクノロジ	4,800	507.00	2,433,600	
サイバーリンクス	6,800	1,157.00	7,867,600	
フィックスターズ	19,200	981.00	18,835,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	8,200	1,939.00	15,899,800	
オプティム	14,100	805.00	11,350,500	
セレス	7,600	1,234.00	9,378,400	
ＳＨＩＦＴ	12,300	17,240.00	212,052,000	
ティーガイア	17,700	1,640.00	29,028,000	
セック	3,000	2,510.00	7,530,000	

テクマトリックス	33,600	1,823.00	61,252,800	
プロシップ	6,700	1,596.00	10,693,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	51,500	2,477.00	127,565,500	
GMOペイメントゲートウェイ	38,400	10,690.00	410,496,000	
ザッパラス	7,400	357.00	2,641,800	
システムリサーチ	5,900	2,091.00	12,336,900	
インターネットイニシアティブ	52,800	5,120.00	270,336,000	
さくらインターネット	21,600	560.00	12,096,000	
ヴィンクス	5,700	1,305.00	7,438,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,400	5,390.00	23,716,000	
ＳＲＡホールディングス	9,600	2,900.00	27,840,000	
システムインテグレータ	6,700	477.00	3,195,900	
朝日ネット	18,400	592.00	10,892,800	
ｅＢＡＳＥ	24,000	549.00	13,176,000	
アバント	21,400	1,449.00	31,008,600	
アドソル日進	7,200	1,618.00	11,649,600	
ＯＤＫソリューションズ	4,500	584.00	2,628,000	
フリービット	10,500	835.00	8,767,500	
コムチュア	22,300	2,798.00	62,395,400	
サイバーコム	3,200	1,339.00	4,284,800	
アステリア	14,500	954.00	13,833,000	
アイル	9,600	1,572.00	15,091,200	
マークラインズ	10,000	2,200.00	22,000,000	
メディカル・データ・ビジョン	25,300	1,129.00	28,563,700	
ｇｕｍｉ	27,800	691.00	19,209,800	
ショーケース	4,800	432.00	2,073,600	
モバイルファクトリー	4,700	1,097.00	5,155,900	
テラスカイ	7,400	1,524.00	11,277,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,900	1,424.00	12,673,600	
ＰＣＩホールディングス	8,000	927.00	7,416,000	
パイプドＨＤ	3,700	2,798.00	10,352,600	
アイビーシー	3,400	428.00	1,455,200	
ネオジャパン	5,800	1,136.00	6,588,800	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	4,300	2,121.00	9,120,300	
ラクス	90,900	1,826.00	165,983,400	
ランドコンピュータ	4,700	876.00	4,117,200	
ダブルスタンダード	6,100	2,018.00	12,309,800	
オープンドア	11,900	1,662.00	19,777,800	
マイネット	7,100	505.00	3,585,500	
アカツキ	8,900	2,671.00	23,771,900	
ベネフィットジャパン	1,600	1,988.00	3,180,800	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	5,300	2,608.00	13,822,400	

カナミックネットワーク	24,500	588.00	14,406,000	
ノムラシステムコーポレーション	22,100	123.00	2,718,300	
チェンジ	41,200	2,164.00	89,156,800	
シンクロ・フード	10,700	379.00	4,055,300	
オークネット	10,600	2,137.00	22,652,200	
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	639.00	2,492,100	
セグエグループ	5,500	537.00	2,953,500	
エイトレッド	2,900	2,027.00	5,878,300	
マクロミル	38,300	948.00	36,308,400	
ビーグリー	4,800	1,297.00	6,225,600	
オロ	6,200	1,711.00	10,608,200	
ユーザーローカル	6,200	1,589.00	9,851,800	
テモナ	4,200	359.00	1,507,800	
ニーズウェル	6,100	632.00	3,855,200	
マネーフォワード	40,400	3,665.00	148,066,000	
サインポスト	6,400	880.00	5,632,000	
電算システムホールディングス	8,200	2,387.00	19,573,400	
ソルクシーズ	17,400	376.00	6,542,400	
フェイス	5,600	591.00	3,309,600	
プロトコーポレーション	21,200	1,063.00	22,535,600	
ハイマックス	5,400	1,398.00	7,549,200	
野村総合研究所	344,200	3,825.00	1,316,565,000	
サイバネットシステム	14,300	850.00	12,155,000	
ＣＥホールディングス	10,100	459.00	4,635,900	
日本システム技術	3,600	2,464.00	8,870,400	
インテージホールディングス	23,000	1,356.00	31,188,000	
東邦システムサイエンス	5,400	918.00	4,957,200	
ソースネクスト	86,300	223.00	19,244,900	
インフォコム	21,700	2,127.00	46,155,900	
シンプレクス・ホールディングス	31,400	1,804.00	56,645,600	
ＨＥＲＯＺ	5,900	832.00	4,908,800	
ラクスル	23,700	1,931.00	45,764,700	
ＩＰＳ	5,500	2,286.00	12,573,000	
ＦＩＧ	22,200	322.00	7,148,400	
システムサポート	7,300	1,266.00	9,241,800	
イーソル	12,500	618.00	7,725,000	
アルテリア・ネットワークス	19,000	1,269.00	24,111,000	
東海ソフト	3,300	931.00	3,072,300	
ウイングアーク１ｓｔ	15,200	1,636.00	24,867,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,600	1,588.00	7,304,800	
サーバーワークス	3,500	2,242.00	7,847,000	
東名	1,600	1,101.00	1,761,600	

ヴィッツ	2,000	1,073.00	2,146,000	
トビラシステムズ	4,200	961.00	4,036,200	
Ｓａｎｓａｎ	62,800	1,009.00	63,365,200	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,900	664.00	2,589,600	
ギフティ	16,400	1,205.00	19,762,000	
ベース	3,400	5,500.00	18,700,000	
ＪＭＤＣ	24,800	6,360.00	157,728,000	
フォーカスシステムズ	12,500	910.00	11,375,000	
クレスコ	14,500	1,944.00	28,188,000	
フジ・メディア・ホールディングス	176,200	1,188.00	209,325,600	
オービック	62,400	21,110.00	1,317,264,000	
ジャストシステム	28,200	3,995.00	112,659,000	
ＴＤＣソフト	15,900	1,116.00	17,744,400	
Ｚホールディングス	2,854,600	437.30	1,248,316,580	
トレンドマイクロ	97,000	7,330.00	711,010,000	
ＩＤホールディングス	12,700	849.00	10,782,300	
日本オラクル	32,200	8,130.00	261,786,000	
アルファシステムズ	5,300	4,600.00	24,380,000	
フューチャー	41,900	1,596.00	66,872,400	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	10,400	1,386.00	14,414,400	
ＳＢテクノロジー	8,600	2,319.00	19,943,400	
トーセ	5,100	754.00	3,845,400	
オービックビジネスコンサルタント	18,900	4,855.00	91,759,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	90,200	3,515.00	317,053,000	
アイティフォー	24,200	797.00	19,287,400	
東計電算	2,400	5,950.00	14,280,000	
エックスネット	3,300	1,013.00	3,342,900	
大塚商会	107,100	4,140.00	443,394,000	
サイボウズ	26,700	1,085.00	28,969,500	
電通国際情報サービス	24,500	4,285.00	104,982,500	
ＡＣＣＥＳＳ	22,600	774.00	17,492,400	
デジタルガレージ	32,800	3,910.00	128,248,000	
ＥＭシステムズ	32,900	1,025.00	33,722,500	
ウェザーニューズ	6,000	7,600.00	45,600,000	
ＣＩＪ	15,600	735.00	11,466,000	
ビジネスエンジニアリング	4,600	2,394.00	11,012,400	
日本エンタープライズ	20,700	154.00	3,187,800	
ＷＯＷＯＷ	8,300	1,507.00	12,508,100	
スカラ	16,900	736.00	12,438,400	
インテリジェント　ウェイブ	10,200	814.00	8,302,800	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	14,300	827.00	11,826,100	
ネットワンシステムズ	73,100	3,210.00	234,651,000	

システムソフト	60,500	106.00	6,413,000	
アルゴグラフィックス	15,500	3,270.00	50,685,000	
マーベラス	31,500	689.00	21,703,500	
エイベックス	34,300	1,455.00	49,906,500	
ＢＩＰＲＯＧＹ	61,900	2,773.00	171,648,700	
兼松エレクトロニクス	10,800	4,110.00	44,388,000	
都築電気	9,000	1,317.00	11,853,000	
ＴＢＳホールディングス	96,800	1,727.00	167,173,600	
日本テレビホールディングス	165,400	1,262.00	208,734,800	
朝日放送グループホールディングス	16,100	658.00	10,593,800	
テレビ朝日ホールディングス	47,700	1,517.00	72,360,900	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	168,000	546.00	91,728,000	
テレビ東京ホールディングス	12,300	1,978.00	24,329,400	
日本ＢＳ放送	6,900	1,065.00	7,348,500	
ビジョン	31,700	1,097.00	34,774,900	
スマートバリュー	4,900	476.00	2,332,400	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	15,200	2,193.00	33,333,600	
ワイヤレスゲート	8,800	288.00	2,534,400	
コネクシオ	14,200	1,350.00	19,170,000	
クロップス	3,800	914.00	3,473,200	
日本電信電話	2,218,500	3,914.00	8,683,209,000	
ＫＤＤＩ	1,443,000	4,433.00	6,396,819,000	
ソフトバンク	2,997,900	1,553.00	4,655,738,700	
光通信	22,800	14,270.00	325,356,000	
エムティーアイ	15,800	501.00	7,915,800	
GMOインターネット	69,400	2,608.00	180,995,200	
ファイバーゲート	9,300	923.00	8,583,900	
アイドママーケティングコミュニケーション	5,000	296.00	1,480,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	106,600	3,175.00	338,455,000	
学研ホールディングス	28,200	941.00	26,536,200	
ゼンリン	32,500	946.00	30,745,000	
昭文社ホールディングス	8,600	363.00	3,121,800	
インプレスホールディングス	16,400	214.00	3,509,600	
アイネット	9,300	1,266.00	11,773,800	
松竹	11,400	12,390.00	141,246,000	
東宝	116,800	5,050.00	589,840,000	
東映	5,600	18,990.00	106,344,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	527,100	1,936.00	1,020,465,600	
ピー・シー・エー	11,800	1,243.00	14,667,400	
ビジネスブレイン太田昭和	6,700	1,477.00	9,895,900	
ＤＴＳ	36,900	3,350.00	123,615,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	92,100	6,210.00	571,941,000	

シーイーシー	21,400	1,226.00	26,236,400	
カプコン	186,700	3,605.00	673,053,500	
アイ・エス・ビー	9,500	1,015.00	9,642,500	
ジャステック	11,600	1,184.00	13,734,400	
ＳＣＳＫ	137,100	2,404.00	329,588,400	
日本システムウエア	7,600	2,397.00	18,217,200	
アイネス	17,100	1,636.00	27,975,600	
ＴＫＣ	30,200	3,430.00	103,586,000	
富士ソフト	19,000	8,180.00	155,420,000	
ＮＳＤ	62,100	2,551.00	158,417,100	
コナミグループ	71,900	7,440.00	534,936,000	
福井コンピュータホールディングス	9,100	3,565.00	32,441,500	
ＪＢＣＣホールディングス	13,500	1,631.00	22,018,500	
ミロク情報サービス	17,600	1,322.00	23,267,200	
ソフトバンクグループ	1,186,900	5,446.00	6,463,857,400	
高千穂交易	7,000	1,968.00	13,776,000	
オルバヘルスケアホールディングス	3,300	1,655.00	5,461,500	
伊藤忠食品	4,000	5,020.00	20,080,000	
エレマテック	15,900	1,247.00	19,827,300	
あらた	14,700	4,105.00	60,343,500	
トーメンデバイス	3,000	5,660.00	16,980,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,900	5,310.00	31,329,000	
フィールズ	17,400	863.00	15,016,200	
双日	203,800	1,938.00	394,964,400	
アルフレッサ　ホールディングス	206,100	1,876.00	386,643,600	
横浜冷凍	48,300	909.00	43,904,700	
ラサ商事	9,100	975.00	8,872,500	
アルコニックス	25,300	1,308.00	33,092,400	
神戸物産	137,100	3,480.00	477,108,000	
ハイパー	5,000	447.00	2,235,000	
あい　ホールディングス	28,400	1,620.00	46,008,000	
ディーブイエックス	6,800	1,066.00	7,248,800	
ダイワボウホールディングス	84,500	1,838.00	155,311,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	47,400	2,614.00	123,903,600	
ラクト・ジャパン	6,800	2,454.00	16,687,200	
グリムス	8,900	1,516.00	13,492,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,700	709.00	22,475,300	
八洲電機	14,400	1,001.00	14,414,400	
メディアスホールディングス	11,400	980.00	11,172,000	
レスターホールディングス	18,800	1,925.00	36,190,000	
ジューテックホールディングス	3,900	1,051.00	4,098,900	
大光	8,500	709.00	6,026,500	

ＯＣＨＩホールディングス	4,500	1,230.00	5,535,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	96,300	887.00	85,418,100	
黒谷	5,500	596.00	3,278,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3,500	717.00	2,509,500	
三洋貿易	18,200	1,001.00	18,218,200	
ビューティガレージ	3,200	2,631.00	8,419,200	
ウイン・パートナーズ	14,400	1,030.00	14,832,000	
ミタチ産業	5,000	862.00	4,310,000	
シップヘルスケアホールディングス	57,300	2,585.00	148,120,500	
明治電機工業	6,000	1,099.00	6,594,000	
デリカフーズホールディングス	7,800	512.00	3,993,600	
スターティアホールディングス	4,600	742.00	3,413,200	
コメダホールディングス	43,400	2,292.00	99,472,800	
ピーバンドットコム	2,900	515.00	1,493,500	
アセンテック	6,900	629.00	4,340,100	
富士興産	5,000	1,072.00	5,360,000	
協栄産業	2,000	1,320.00	2,640,000	
フルサト・マルカホールディングス	17,600	2,692.00	47,379,200	
ヤマエグループホールディングス	11,200	1,400.00	15,680,000	
小野建	17,800	1,410.00	25,098,000	
南陽	3,800	1,782.00	6,771,600	
佐鳥電機	12,400	1,084.00	13,441,600	
エコートレーディング	4,200	574.00	2,410,800	
伯東	11,600	2,541.00	29,475,600	
コンドーテック	14,900	1,013.00	15,093,700	
中山福	10,600	316.00	3,349,600	
ナガイレーベン	24,000	2,000.00	48,000,000	
三菱食品	19,100	3,715.00	70,956,500	
松田産業	14,500	2,073.00	30,058,500	
第一興商	37,700	3,780.00	142,506,000	
メディパルホールディングス	183,800	1,994.00	366,497,200	
ＳＰＫ	7,900	1,416.00	11,186,400	
萩原電気ホールディングス	6,800	1,993.00	13,552,400	
アズワン	28,500	6,140.00	174,990,000	
スズデン	6,200	1,955.00	12,121,000	
尾家産業	4,700	834.00	3,919,800	
シモジマ	12,200	989.00	12,065,800	
ドウシシャ	18,800	1,578.00	29,666,400	
小津産業	4,400	1,898.00	8,351,200	
高速	10,500	1,540.00	16,170,000	
たけびし	6,800	1,499.00	10,193,200	
リックス	4,100	2,049.00	8,400,900	

丸文	15,900	735.00	11,686,500	
ハピネット	15,100	1,588.00	23,978,800	
橋本総業ホールディングス	3,500	2,004.00	7,014,000	
日本ライフライン	58,900	941.00	55,424,900	
タカショー	15,500	741.00	11,485,500	
ＩＤＯＭ	60,300	773.00	46,611,900	
進和	11,800	2,203.00	25,995,400	
エスケイジャパン	4,900	461.00	2,258,900	
ダイトロン	7,700	1,815.00	13,975,500	
シークス	25,300	948.00	23,984,400	
田中商事	6,200	588.00	3,645,600	
オーハシテクニカ	9,800	1,373.00	13,455,400	
白銅	6,400	2,390.00	15,296,000	
ダイコー通産	2,400	1,115.00	2,676,000	
伊藤忠商事	1,191,000	3,865.00	4,603,215,000	
丸紅	1,720,900	1,205.00	2,073,684,500	
高島	2,800	2,635.00	7,378,000	
長瀬産業	90,900	1,922.00	174,709,800	
蝶理	11,100	1,972.00	21,889,200	
豊田通商	177,400	4,435.00	786,769,000	
三共生興	25,500	519.00	13,234,500	
兼松	68,800	1,371.00	94,324,800	
ツカモトコーポレーション	3,300	1,095.00	3,613,500	
三井物産	1,439,800	2,902.00	4,178,299,600	
日本紙パルプ商事	9,400	4,000.00	37,600,000	
カメイ	21,200	1,081.00	22,917,200	
東都水産	1,000	4,480.00	4,480,000	
ＯＵＧホールディングス	2,900	2,799.00	8,117,100	
スターゼン	13,500	2,070.00	27,945,000	
山善	71,700	1,003.00	71,915,100	
椿本興業	3,300	3,670.00	12,111,000	
住友商事	1,175,500	1,877.50	2,207,001,250	
内田洋行	7,800	5,150.00	40,170,000	
三菱商事	1,302,500	3,905.00	5,086,262,500	
第一実業	7,600	3,410.00	25,916,000	
キヤノンマーケティングジャパン	49,300	2,896.00	142,772,800	
西華産業	8,500	1,653.00	14,050,500	
佐藤商事	13,700	1,114.00	15,261,800	
菱洋エレクトロ	11,800	2,298.00	27,116,400	
東京産業	16,200	722.00	11,696,400	
ユアサ商事	16,000	3,550.00	56,800,000	
神鋼商事	4,500	3,825.00	17,212,500	

トルク	10,700	197.00	2,107,900	
阪和興業	34,500	2,837.00	97,876,500	
正栄食品工業	12,900	3,885.00	50,116,500	
カナデン	16,200	1,045.00	16,929,000	
菱電商事	15,800	1,632.00	25,785,600	
岩谷産業	44,000	5,340.00	234,960,000	
ナイス	6,100	1,709.00	10,424,900	
ニチモウ	2,400	2,367.00	5,680,800	
極東貿易	5,700	2,653.00	15,122,100	
アステナホールディングス	25,600	460.00	11,776,000	
三愛オブリ	44,500	1,041.00	46,324,500	
稲畑産業	39,800	2,317.00	92,216,600	
ＧＳＩクレオス	9,500	1,398.00	13,281,000	
明和産業	18,400	731.00	13,450,400	
クワザワホールディングス	7,200	445.00	3,204,000	
ワキタ	35,900	1,111.00	39,884,900	
東邦ホールディングス	53,900	2,122.00	114,375,800	
サンゲツ	48,200	1,600.00	77,120,000	
ミツウロコグループホールディングス	22,800	932.00	21,249,600	
シナネンホールディングス	6,500	3,555.00	23,107,500	
伊藤忠エネクス	44,000	1,055.00	46,420,000	
サンリオ	55,800	3,025.00	168,795,000	
サンワテクノス	10,100	1,311.00	13,241,100	
リョーサン	20,400	2,178.00	44,431,200	
新光商事	26,200	900.00	23,580,000	
トーホー	7,600	1,341.00	10,191,600	
三信電気	8,200	1,553.00	12,734,600	
東陽テクニカ	19,600	1,138.00	22,304,800	
モスフードサービス	26,100	3,245.00	84,694,500	
加賀電子	16,200	3,060.00	49,572,000	
ソーダニッカ	15,900	579.00	9,206,100	
立花エレテック	13,000	1,536.00	19,968,000	
フォーバル	7,000	862.00	6,034,000	
ＰＡＬＴＡＣ	27,900	4,390.00	122,481,000	
三谷産業	31,100	321.00	9,983,100	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4,500	4,000.00	18,000,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,800	1,788.00	3,218,400	
コーア商事ホールディングス	12,500	712.00	8,900,000	
国際紙パルプ商事	36,800	483.00	17,774,400	
ヤマタネ	8,600	1,602.00	13,777,200	
丸紅建材リース	1,700	1,911.00	3,248,700	
日鉄物産	12,100	5,030.00	60,863,000	

泉州電業	4,900	5,060.00	24,794,000	
トラスコ中山	41,400	1,862.00	77,086,800	
オートバックスセブン	61,700	1,424.00	87,860,800	
モリト	14,500	782.00	11,339,000	
加藤産業	21,500	3,320.00	71,380,000	
北恵	5,100	830.00	4,233,000	
イノテック	12,000	1,324.00	15,888,000	
イエローハット	31,300	1,736.00	54,336,800	
ＪＫホールディングス	14,000	984.00	13,776,000	
日伝	13,500	1,945.00	26,257,500	
北沢産業	10,900	203.00	2,212,700	
杉本商事	9,300	2,093.00	19,464,900	
因幡電機産業	49,500	2,761.00	136,669,500	
東テク	5,900	3,150.00	18,585,000	
ミスミグループ本社	249,400	3,115.00	776,881,000	
アルテック	12,300	273.00	3,357,900	
タキヒヨー	5,400	933.00	5,038,200	
蔵王産業	3,800	1,846.00	7,014,800	
スズケン	71,200	3,915.00	278,748,000	
ジェコス	13,700	848.00	11,617,600	
グローセル	21,600	404.00	8,726,400	
ローソン	44,000	4,580.00	201,520,000	
サンエー	13,600	4,175.00	56,780,000	
カワチ薬品	15,600	2,169.00	33,836,400	
エービーシー・マート	31,100	5,830.00	181,313,000	
ハードオフコーポレーション	9,200	924.00	8,500,800	
アスクル	43,000	1,699.00	73,057,000	
ゲオホールディングス	24,200	1,305.00	31,581,000	
アダストリア	21,600	2,064.00	44,582,400	
くら寿司	20,900	3,320.00	69,388,000	
キャンドゥ	7,500	2,218.00	16,635,000	
アイケイ	7,000	442.00	3,094,000	
パルグループホールディングス	17,600	1,763.00	31,028,800	
エディオン	91,500	1,298.00	118,767,000	
サーラコーポレーション	40,900	705.00	28,834,500	
ワッツ	10,100	723.00	7,302,300	
ハローズ	9,200	3,050.00	28,060,000	
フジオフードグループ本社	14,700	1,347.00	19,800,900	
あみやき亭	4,800	2,981.00	14,308,800	
大黒天物産	6,400	4,645.00	29,728,000	
ハニーズホールディングス	16,000	1,256.00	20,096,000	
ファーマライズホールディングス	4,800	700.00	3,360,000	

アルペン	14,800	2,136.00	31,612,800	
ハブ	7,100	539.00	3,826,900	
クオールホールディングス	24,600	1,398.00	34,390,800	
ジンズホールディングス	10,600	4,420.00	46,852,000	
ビックカメラ	118,100	1,177.00	139,003,700	
ＤＣＭホールディングス	118,400	1,019.00	120,649,600	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	251,300	2,222.00	558,388,600	
東京一番フーズ	5,100	592.00	3,019,200	
きちりホールディングス	5,300	372.00	1,971,600	
アークランドサービスホールディングス	14,700	2,149.00	31,590,300	
Ｊ．フロント　リテイリング	220,600	1,076.00	237,365,600	
ドトール・日レスホールディングス	31,700	1,555.00	49,293,500	
マツキヨココカラ＆カンパニー	116,500	5,220.00	608,130,000	
ブロンコビリー	10,500	2,363.00	24,811,500	
ＺＯＺＯ	136,800	2,840.00	388,512,000	
トレジャー・ファクトリー	6,100	1,218.00	7,429,800	
物語コーポレーション	9,900	5,560.00	55,044,000	
三越伊勢丹ホールディングス	298,500	1,034.00	308,649,000	
Ｈａｍｅｅ	7,500	1,059.00	7,942,500	
マーケットエンタープライズ	2,300	1,158.00	2,663,400	
ウエルシアホールディングス	105,200	2,988.00	314,337,600	
クリエイトＳＤホールディングス	29,400	3,145.00	92,463,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	23,200	374.00	8,676,800	
ミサワ	4,600	607.00	2,792,200	
ティーライフ	2,900	1,397.00	4,051,300	
チムニー	6,100	1,234.00	7,527,400	
シュッピン	16,800	1,342.00	22,545,600	
オイシックス・ラ・大地	28,800	1,795.00	51,696,000	
ネクステージ	40,500	2,502.00	101,331,000	
ジョイフル本田	57,200	1,623.00	92,835,600	
鳥貴族ホールディングス	6,700	2,202.00	14,753,400	
ホットランド	15,100	1,325.00	20,007,500	
すかいらーくホールディングス	242,400	1,607.00	389,536,800	
ＳＦＰホールディングス	9,700	1,580.00	15,326,000	
綿半ホールディングス	14,000	1,394.00	19,516,000	
ヨシックスホールディングス	4,000	2,339.00	9,356,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	58,100	1,106.00	64,258,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	10,600	1,354.00	14,352,400	
ＢＥＥＮＯＳ	10,200	2,414.00	24,622,800	
あさひ	16,700	1,305.00	21,793,500	
日本調剤	12,300	1,350.00	16,605,000	
コスモス薬品	20,100	13,260.00	266,526,000	

トーエル	9,100	921.00	8,381,100	
セブン&アイ・ホールディングス	666,200	5,482.00	3,652,108,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	133,300	918.00	122,369,400	
ツルハホールディングス	43,400	7,550.00	327,670,000	
サンマルクホールディングス	15,900	1,584.00	25,185,600	
フェリシモ	4,700	1,115.00	5,240,500	
トリドールホールディングス	49,600	2,592.00	128,563,200	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	19,400	330.00	6,402,000	
ウイルプラスホールディングス	4,200	864.00	3,628,800	
ＪＭホールディングス	15,300	1,670.00	25,551,000	
サツドラホールディングス	9,400	670.00	6,298,000	
アレンザホールディングス	13,600	1,045.00	14,212,000	
串カツ田中ホールディングス	5,500	1,877.00	10,323,500	
バロックジャパンリミテッド	14,300	820.00	11,726,000	
クスリのアオキホールディングス	17,800	5,550.00	98,790,000	
力の源ホールディングス	10,200	662.00	6,752,400	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	101,900	2,742.00	279,409,800	
メディカルシステムネットワーク	18,100	444.00	8,036,400	
はるやまホールディングス	10,100	447.00	4,514,700	
ノジマ	32,200	2,912.00	93,766,400	
カッパ・クリエイト	27,800	1,466.00	40,754,800	
ライトオン	14,800	745.00	11,026,000	
良品計画	228,900	1,269.00	290,474,100	
パリミキホールディングス	26,000	271.00	7,046,000	
アドヴァングループ	17,300	807.00	13,961,100	
アルビス	6,000	2,260.00	13,560,000	
コナカ	21,500	342.00	7,353,000	
ハウス　オブ　ローゼ	2,700	1,659.00	4,479,300	
Ｇ－７ホールディングス	22,300	1,474.00	32,870,200	
イオン北海道	26,400	1,091.00	28,802,400	
コジマ	34,700	667.00	23,144,900	
ヒマラヤ	6,600	987.00	6,514,200	
コーナン商事	28,300	3,685.00	104,285,500	
エコス	6,700	2,355.00	15,778,500	
ワタミ	24,100	912.00	21,979,200	
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	397,300	2,176.00	864,524,800	
西松屋チェーン	39,500	1,512.00	59,724,000	
ゼンショーホールディングス	97,100	3,380.00	328,198,000	
幸楽苑ホールディングス	11,600	1,284.00	14,894,400	
ハークスレイ	9,000	566.00	5,094,000	

サイゼリヤ	29,600	2,631.00	77,877,600	
ＶＴホールディングス	75,500	491.00	37,070,500	
魚力	5,700	2,484.00	14,158,800	
フジ・コーポレーション	10,800	1,286.00	13,888,800	
ユナイテッドアローズ	21,000	1,872.00	39,312,000	
ハイデイ日高	28,800	2,110.00	60,768,000	
ＹＵ−ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	13,400	209.00	2,800,600	
コロワイド	81,600	1,865.00	152,184,000	
ピーシーデポコーポレーション	24,300	313.00	7,605,900	
壱番屋	14,100	4,790.00	67,539,000	
ＰＬＡＮＴ	5,100	644.00	3,284,400	
スギホールディングス	39,700	6,160.00	244,552,000	
薬王堂ホールディングス	10,100	2,108.00	21,290,800	
スクロール	31,000	929.00	28,799,000	
ヨンドシーホールディングス	17,000	1,761.00	29,937,000	
木曽路	26,600	2,205.00	58,653,000	
ＳＲＳホールディングス	29,000	871.00	25,259,000	
千趣会	36,900	384.00	14,169,600	
リテールパートナーズ	26,600	1,185.00	31,521,000	
ケーヨー	37,000	910.00	33,670,000	
上新電機	19,500	1,971.00	38,434,500	
日本瓦斯	95,100	1,932.00	183,733,200	
ロイヤルホールディングス	30,700	2,154.00	66,127,800	
いなげや	19,900	1,305.00	25,969,500	
チヨダ	17,400	803.00	13,972,200	
ライフコーポレーション	15,600	2,686.00	41,901,600	
リンガーハット	22,900	2,410.00	55,189,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	25,400	630.00	16,002,000	
ＡＯＫＩホールディングス	39,000	681.00	26,559,000	
オークワ	28,600	877.00	25,082,200	
コメリ	30,800	2,650.00	81,620,000	
青山商事	38,300	861.00	32,976,300	
しまむら	23,100	12,420.00	286,902,000	
はせがわ	12,000	252.00	3,024,000	
高島屋	133,700	1,381.00	184,639,700	
松屋	33,600	856.00	28,761,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	86,500	1,001.00	86,586,500	
近鉄百貨店	5,900	2,382.00	14,053,800	
丸井グループ	143,800	2,309.00	332,034,200	
アクシアル　リテイリング	13,300	3,315.00	44,089,500	
イオン	655,300	2,665.00	1,746,374,500	
イズミ	31,500	3,080.00	97,020,000	

平和堂	29,700	1,995.00	59,251,500	
フジ	43,600	2,245.00	97,882,000	
ヤオコー	22,600	6,330.00	143,058,000	
ゼビオホールディングス	27,400	913.00	25,016,200	
ケーズホールディングス	169,400	1,401.00	237,329,400	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	9,400	639.00	6,006,600	
日産東京販売ホールディングス	30,600	272.00	8,323,200	
シルバーライフ	4,300	1,350.00	5,805,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	8,800	3,375.00	29,700,000	
ナルミヤ・インターナショナル	4,900	879.00	4,307,100	
ブックオフグループホールディングス	11,600	1,040.00	12,064,000	
ギフトホールディングス	3,300	2,191.00	7,230,300	
アインホールディングス	24,500	7,720.00	189,140,000	
元気寿司	5,700	2,550.00	14,535,000	
ヤマダホールディングス	703,600	496.00	348,985,600	
アークランドサカモト	31,300	1,594.00	49,892,200	
ニトリホールディングス	78,900	13,765.00	1,086,058,500	
グルメ杵屋	16,100	1,025.00	16,502,500	
愛眼	14,500	181.00	2,624,500	
ケーユーホールディングス	10,700	1,049.00	11,224,300	
吉野家ホールディングス	69,500	2,444.00	169,858,000	
松屋フーズホールディングス	9,600	4,070.00	39,072,000	
サガミホールディングス	28,800	1,142.00	32,889,600	
関西フードマーケット	16,300	1,232.00	20,081,600	
王将フードサービス	13,200	6,850.00	90,420,000	
プレナス	22,400	2,020.00	45,248,000	
ミニストップ	14,900	1,500.00	22,350,000	
アークス	35,400	2,124.00	75,189,600	
バローホールディングス	40,800	1,933.00	78,866,400	
ベルク	8,900	5,250.00	46,725,000	
大庄	10,900	1,187.00	12,938,300	
ファーストリテイリング	26,600	68,900.00	1,832,740,000	
サンドラッグ	74,900	3,140.00	235,186,000	
サックスバー　ホールディングス	19,300	632.00	12,197,600	
ヤマザワ	4,400	1,495.00	6,578,000	
やまや	4,100	2,566.00	10,520,600	
ベルーナ	43,100	775.00	33,402,500	
島根銀行	6,300	499.00	3,143,700	
じもとホールディングス	13,200	580.00	7,656,000	
めぶきフィナンシャルグループ	818,400	269.00	220,149,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	23,000	2,277.00	52,371,000	
九州フィナンシャルグループ	348,200	392.00	136,494,400	

ゆうちょ銀行	469,600	1,072.00	503,411,200	
富山第一銀行	44,300	426.00	18,871,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	984,700	462.00	454,931,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	104,400	757.00	79,030,800	
三十三フィナンシャルグループ	16,000	1,423.00	22,768,000	
第四北越フィナンシャルグループ	28,100	2,575.00	72,357,500	
ひろぎんホールディングス	254,300	629.00	159,954,700	
おきなわフィナンシャルグループ	16,800	2,177.00	36,573,600	
十六フィナンシャルグループ	23,200	2,403.00	55,749,600	
北國フィナンシャルホールディングス	16,400	4,705.00	77,162,000	
プロクレアホールディングス	20,200	2,034.00	41,086,800	
新生銀行	129,800	2,037.00	264,402,600	
あおぞら銀行	111,100	2,721.00	302,303,100	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,644,300	739.50	8,610,959,850	
りそなホールディングス	2,104,900	513.40	1,080,655,660	
三井住友トラスト・ホールディングス	329,000	4,279.00	1,407,791,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,291,000	4,128.00	5,329,248,000	
千葉銀行	561,800	752.00	422,473,600	
群馬銀行	320,000	386.00	123,520,000	
武蔵野銀行	25,400	1,796.00	45,618,400	
千葉興業銀行	42,900	256.00	10,982,400	
筑波銀行	77,500	194.00	15,035,000	
七十七銀行	52,800	1,773.00	93,614,400	
秋田銀行	11,900	1,674.00	19,920,600	
山形銀行	18,300	922.00	16,872,600	
岩手銀行	12,200	1,995.00	24,339,000	
東邦銀行	142,300	209.00	29,740,700	
東北銀行	8,900	976.00	8,686,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	143,600	2,428.00	348,660,800	
静岡銀行	409,900	820.00	336,118,000	
スルガ銀行	174,400	376.00	65,574,400	
八十二銀行	369,000	508.00	187,452,000	
山梨中央銀行	20,000	1,185.00	23,700,000	
大垣共立銀行	34,100	1,751.00	59,709,100	
福井銀行	15,900	1,388.00	22,069,200	
清水銀行	7,100	1,492.00	10,593,200	
富山銀行	3,100	1,859.00	5,762,900	
滋賀銀行	32,400	2,713.00	87,901,200	
南都銀行	26,900	2,035.00	54,741,500	
百五銀行	167,100	330.00	55,143,000	
京都銀行	61,700	5,770.00	356,009,000	
紀陽銀行	59,000	1,406.00	82,954,000	

ほくほくフィナンシャルグループ	112,900	851.00	96,077,900	
山陰合同銀行	110,600	669.00	73,991,400	
中国銀行	140,000	987.00	138,180,000	
鳥取銀行	6,300	1,176.00	7,408,800	
伊予銀行	223,000	663.00	147,849,000	
百十四銀行	18,300	1,692.00	30,963,600	
四国銀行	26,200	854.00	22,374,800	
阿波銀行	26,400	2,054.00	54,225,600	
大分銀行	10,700	1,881.00	20,126,700	
宮崎銀行	10,800	2,089.00	22,561,200	
佐賀銀行	10,500	1,510.00	15,855,000	
琉球銀行	43,200	803.00	34,689,600	
セブン銀行	590,800	262.00	154,789,600	
みずほフィナンシャルグループ	2,385,200	1,582.50	3,774,579,000	
高知銀行	6,300	704.00	4,435,200	
山口フィナンシャルグループ	198,600	762.00	151,333,200	
長野銀行	6,100	1,321.00	8,058,100	
名古屋銀行	12,200	3,105.00	37,881,000	
北洋銀行	249,900	231.00	57,726,900	
愛知銀行	6,200	5,350.00	33,170,000	
中京銀行	6,100	1,731.00	10,559,100	
大光銀行	5,900	1,400.00	8,260,000	
愛媛銀行	25,900	908.00	23,517,200	
トマト銀行	6,000	1,010.00	6,060,000	
京葉銀行	83,000	470.00	39,010,000	
栃木銀行	89,200	264.00	23,548,800	
北日本銀行	5,800	1,675.00	9,715,000	
東和銀行	32,600	524.00	17,082,400	
福島銀行	21,000	218.00	4,578,000	
大東銀行	8,700	653.00	5,681,100	
トモニホールディングス	143,500	318.00	45,633,000	
フィデアホールディングス	18,200	1,319.00	24,005,800	
池田泉州ホールディングス	211,200	202.00	42,662,400	
ＦＰＧ	67,200	933.00	62,697,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	15,600	1,276.00	19,905,600	
マーキュリアホールディングス	11,200	612.00	6,854,400	
ＳＢＩホールディングス	245,800	2,714.00	667,101,200	
ジャフコ　グループ	69,000	1,726.00	119,094,000	
大和証券グループ本社	1,278,000	622.00	794,916,000	
野村ホールディングス	3,037,900	511.80	1,554,797,220	
岡三証券グループ	144,200	349.00	50,325,800	
丸三証券	59,600	495.00	29,502,000	

東洋証券	61,500	213.00	13,099,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	196,500	381.00	74,866,500	
光世証券	4,700	450.00	2,115,000	
水戸証券	49,700	264.00	13,120,800	
いちよし証券	33,300	646.00	21,511,800	
松井証券	97,700	813.00	79,430,100	
マネックスグループ	168,100	455.00	76,485,500	
極東証券	23,000	705.00	16,215,000	
岩井コスモホールディングス	19,000	1,279.00	24,301,000	
アイザワ証券グループ	27,200	725.00	19,720,000	
マネーパートナーズグループ	22,200	254.00	5,638,800	
スパークス・グループ	92,800	281.00	26,076,800	
かんぽ生命保険	200,200	2,198.00	440,039,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	283,100	6,069.00	1,718,133,900	
アニコム　ホールディングス	61,100	666.00	40,692,600	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	408,900	4,341.00	1,775,034,900	
第一生命ホールディングス	968,800	2,442.50	2,366,294,000	
東京海上ホールディングス	553,600	8,188.00	4,532,876,800	
Ｔ＆Ｄホールディングス	442,600	1,596.00	706,389,600	
アドバンスクリエイト	9,500	977.00	9,281,500	
全国保証	47,600	4,365.00	207,774,000	
あんしん保証	9,800	265.00	2,597,000	
イントラスト	9,300	571.00	5,310,300	
日本モーゲージサービス	11,600	988.00	11,460,800	
Ｃａｓａ	7,600	885.00	6,726,000	
アルヒ	29,900	1,023.00	30,587,700	
プレミアグループ	10,200	4,370.00	44,574,000	
ネットプロテクションズホールディングス	61,500	553.00	34,009,500	
クレディセゾン	116,500	1,581.00	184,186,500	
芙蓉総合リース	17,100	7,920.00	135,432,000	
みずほリース	24,700	3,240.00	80,028,000	
東京センチュリー	30,900	4,645.00	143,530,500	
日本証券金融	78,800	870.00	68,556,000	
アイフル	335,300	369.00	123,725,700	
リコーリース	17,800	3,615.00	64,347,000	
イオンフィナンシャルサービス	108,600	1,308.00	142,048,800	
アコム	394,000	328.00	129,232,000	
ジャックス	19,900	3,445.00	68,555,500	
オリエントコーポレーション	542,200	128.00	69,401,600	
オリックス	1,182,100	2,318.50	2,740,698,850	
三菱ＨＣキャピタル	643,800	629.00	404,950,200	
九州リースサービス	9,400	569.00	5,348,600	

日本取引所グループ	463,700	2,117.50	981,884,750	
イー・ギャランティ	29,800	2,247.00	66,960,600	
アサックス	11,200	613.00	6,865,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	8,300	2,067.00	17,156,100	
いちご	227,300	314.00	71,372,200	
日本駐車場開発	207,300	172.00	35,655,600	
スター・マイカ・ホールディングス	12,000	1,467.00	17,604,000	
ＳＲＥホールディングス	5,900	2,699.00	15,924,100	
ＡＤワークスグループ	35,500	150.00	5,325,000	
ヒューリック	434,500	1,073.00	466,218,500	
三栄建築設計	9,100	1,633.00	14,860,300	
野村不動産ホールディングス	103,500	3,245.00	335,857,500	
三重交通グループホールディングス	44,100	478.00	21,079,800	
サムティ	30,000	2,064.00	61,920,000	
ディア・ライフ	27,700	607.00	16,813,900	
地主	13,500	2,058.00	27,783,000	
プレサンスコーポレーション	22,900	1,535.00	35,151,500	
ハウスコム	5,500	891.00	4,900,500	
ＪＰＭＣ	11,400	1,024.00	11,673,600	
サンセイランディック	8,000	855.00	6,840,000	
フージャースホールディングス	25,400	800.00	20,320,000	
オープンハウスグループ	63,600	5,710.00	363,156,000	
東急不動産ホールディングス	543,400	706.00	383,640,400	
飯田グループホールディングス	166,800	2,143.00	357,452,400	
イーグランド	4,100	1,428.00	5,854,800	
ムゲンエステート	16,100	483.00	7,776,300	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	9,800	827.00	8,104,600	
シーアールイー	8,600	1,675.00	14,405,000	
ケイアイスター不動産	9,300	4,670.00	43,431,000	
グッドコムアセット	10,100	1,274.00	12,867,400	
ジェイ・エス・ビー	4,600	3,195.00	14,697,000	
ロードスターキャピタル	6,000	1,945.00	11,670,000	
テンポイノベーション	7,700	862.00	6,637,400	
フェイスネットワーク	3,900	1,383.00	5,393,700	
パーク２４	118,800	1,765.00	209,682,000	
パラカ	6,900	1,826.00	12,599,400	
三井不動産	776,900	2,902.00	2,254,563,800	
三菱地所	1,133,700	1,981.50	2,246,426,550	
平和不動産	32,100	3,985.00	127,918,500	
東京建物	171,200	1,963.00	336,065,600	
京阪神ビルディング	27,400	1,314.00	36,003,600	
住友不動産	358,300	3,567.00	1,278,056,100	

テーオーシー	32,400	782.00	25,336,800	
東京楽天地	3,300	3,980.00	13,134,000	
スターツコーポレーション	27,700	2,833.00	78,474,100	
フジ住宅	25,900	665.00	17,223,500	
空港施設	23,400	549.00	12,846,600	
明和地所	12,300	626.00	7,699,800	
ゴールドクレスト	16,800	1,743.00	29,282,400	
エスリード	8,900	1,693.00	15,067,700	
日神グループホールディングス	36,600	433.00	15,847,800	
日本エスコン	37,000	779.00	28,823,000	
タカラレーベン	83,300	357.00	29,738,100	
ＡＶＡＮＴＩＡ	11,600	808.00	9,372,800	
イオンモール	100,800	1,682.00	169,545,600	
毎日コムネット	9,700	630.00	6,111,000	
ファースト住建	9,100	1,118.00	10,173,800	
カチタス	49,800	3,210.00	159,858,000	
トーセイ	28,900	1,220.00	35,258,000	
穴吹興産	5,200	2,101.00	10,925,200	
サンフロンティア不動産	29,100	1,105.00	32,155,500	
ＦＪネクストホールディングス	21,300	1,075.00	22,897,500	
インテリックス	4,500	580.00	2,610,000	
ランドビジネス	6,700	228.00	1,527,600	
サンネクスタグループ	8,200	1,047.00	8,585,400	
グランディハウス	17,100	538.00	9,199,800	
日本空港ビルデング	64,500	5,120.00	330,240,000	
明豊ファシリティワークス	9,400	644.00	6,053,600	
日本工営	12,400	3,340.00	41,416,000	
ＬＩＦＵＬＬ	61,000	172.00	10,492,000	
ミクシィ	44,200	2,252.00	99,538,400	
ジェイエイシーリクルートメント	15,700	1,850.00	29,045,000	
日本M&Aセンターホールディングス	316,400	1,637.00	517,946,800	
メンバーズ	5,200	2,651.00	13,785,200	
中広	4,000	385.00	1,540,000	
ＵＴグループ	28,000	2,528.00	70,784,000	
アイティメディア	9,400	1,615.00	15,181,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	11,400	1,193.00	13,600,200	
夢真ビーネックスグループ	63,100	1,599.00	100,896,900	
コシダカホールディングス	52,000	714.00	37,128,000	
アルトナー	5,100	887.00	4,523,700	
パソナグループ	21,100	1,957.00	41,292,700	
ＣＤＳ	5,000	1,776.00	8,880,000	
リンクアンドモチベーション	42,500	501.00	21,292,500	

エス・エム・エス	65,600	2,892.00	189,715,200	
サニーサイドアップグループ	7,200	661.00	4,759,200	
パーソルホールディングス	192,800	2,700.00	520,560,000	
リニカル	11,300	799.00	9,028,700	
クックパッド	62,300	206.00	12,833,800	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	10,000	599.00	5,990,000	
学情	8,200	992.00	8,134,400	
スタジオアリス	8,800	2,378.00	20,926,400	
シミックホールディングス	9,700	1,498.00	14,530,600	
エプコ	4,600	711.00	3,270,600	
ＮＪＳ	4,400	1,951.00	8,584,400	
綜合警備保障	70,400	3,875.00	272,800,000	
カカクコム	141,600	2,339.00	331,202,400	
アイロムグループ	6,900	1,890.00	13,041,000	
セントケア・ホールディング	12,900	890.00	11,481,000	
サイネックス	3,800	594.00	2,257,200	
ルネサンス	13,800	941.00	12,985,800	
ディップ	34,000	3,750.00	127,500,000	
デジタルホールディングス	13,700	1,246.00	17,070,200	
新日本科学	23,600	2,073.00	48,922,800	
キャリアデザインセンター	4,300	1,176.00	5,056,800	
ベネフィット・ワン	70,300	1,965.00	138,139,500	
エムスリー	340,200	4,054.00	1,379,170,800	
ツカダ・グローバルホールディング	12,300	328.00	4,034,400	
アウトソーシング	110,700	1,115.00	123,430,500	
ウェルネット	17,800	463.00	8,241,400	
ワールドホールディングス	7,900	2,287.00	18,067,300	
ディー・エヌ・エー	73,600	1,880.00	138,368,000	
博報堂ＤＹホールディングス	244,200	1,280.00	312,576,000	
ぐるなび	29,000	373.00	10,817,000	
タカミヤ	24,300	376.00	9,136,800	
ジャパンベストレスキューシステム	10,900	760.00	8,284,000	
ファンコミュニケーションズ	44,300	390.00	17,277,000	
ライク	6,600	2,290.00	15,114,000	
ビジネス・ブレークスルー	8,000	424.00	3,392,000	
エスプール	54,700	990.00	54,153,000	
ＷＤＢホールディングス	8,900	2,497.00	22,223,300	
ティア	12,000	432.00	5,184,000	
ＣＤＧ	2,300	1,272.00	2,925,600	
アドウェイズ	29,500	678.00	20,001,000	
バリューコマース	15,200	3,155.00	47,956,000	
インフォマート	212,100	386.00	81,870,600	

ＪＰホールディングス	50,900	254.00	12,928,600	
エコナックホールディングス	36,900	92.00	3,394,800	
ＣＬホールディングス	4,500	924.00	4,158,000	
プレステージ・インターナショナル	72,800	698.00	50,814,400	
アミューズ	10,700	2,015.00	21,560,500	
ドリームインキュベータ	6,100	1,967.00	11,998,700	
クイック	12,200	1,452.00	17,714,400	
ＴＡＣ	12,100	215.00	2,601,500	
電通グループ	180,700	4,215.00	761,650,500	
イオンファンタジー	7,600	2,496.00	18,969,600	
シーティーエス	22,200	841.00	18,670,200	
ネクシィーズグループ	6,500	561.00	3,646,500	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	50,500	3,070.00	155,035,000	
アルプス技研	16,500	1,820.00	30,030,000	
ダイオーズ	4,100	1,086.00	4,452,600	
日本空調サービス	20,600	793.00	16,335,800	
オリエンタルランド	205,000	18,590.00	3,810,950,000	
ダスキン	41,600	2,937.00	122,179,200	
明光ネットワークジャパン	23,200	616.00	14,291,200	
ファルコホールディングス	8,700	1,924.00	16,738,800	
ラウンドワン	54,000	1,411.00	76,194,000	
リゾートトラスト	81,700	2,054.00	167,811,800	
ビー・エム・エル	24,600	3,655.00	89,913,000	
りらいあコミュニケーションズ	28,700	1,096.00	31,455,200	
リソー教育	89,100	324.00	28,868,400	
早稲田アカデミー	11,000	1,159.00	12,749,000	
ユー・エス・エス	215,900	2,457.00	530,466,300	
東京個別指導学院	17,600	616.00	10,841,600	
サイバーエージェント	411,900	1,358.00	559,360,200	
楽天グループ	895,100	647.00	579,129,700	
クリーク・アンド・リバー社	10,300	2,279.00	23,473,700	
モーニングスター	34,400	529.00	18,197,600	
テー・オー・ダブリュー	37,900	314.00	11,900,600	
山田コンサルティンググループ	10,300	1,167.00	12,020,100	
セントラルスポーツ	7,300	2,502.00	18,264,600	
フルキャストホールディングス	16,600	2,427.00	40,288,200	
エン・ジャパン	34,400	1,926.00	66,254,400	
リソルホールディングス	2,200	4,600.00	10,120,000	
テクノプロ・ホールディングス	115,500	3,095.00	357,472,500	
アトラグループ	4,300	191.00	821,300	
インターワークス	6,500	366.00	2,379,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,100	2,160.00	19,656,000	

ＫｅｅＰｅｒ技研	12,500	3,395.00	42,437,500	
ファーストロジック	3,400	779.00	2,648,600	
三機サービス	3,700	1,000.00	3,700,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	11,100	729.00	8,091,900	
デザインワン・ジャパン	7,700	180.00	1,386,000	
イー・ガーディアン	6,600	2,930.00	19,338,000	
リブセンス	12,900	179.00	2,309,100	
ジャパンマテリアル	59,400	1,845.00	109,593,000	
ベクトル	27,400	1,003.00	27,482,200	
ウチヤマホールディングス	10,700	295.00	3,156,500	
チャーム・ケア・コーポレーション	14,700	1,021.00	15,008,700	
キャリアリンク	7,300	1,975.00	14,417,500	
ＩＢＪ	16,200	755.00	12,231,000	
アサンテ	8,700	1,531.00	13,319,700	
バリューＨＲ	16,900	1,350.00	22,815,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	16,000	3,505.00	56,080,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,800	1,240.00	9,672,000	
ＥＲＩホールディングス	5,700	1,208.00	6,885,600	
アビスト	3,100	2,744.00	8,506,400	
シグマクシス・ホールディングス	23,500	1,184.00	27,824,000	
ウィルグループ	14,600	1,203.00	17,563,800	
エスクロー・エージェント・ジャパン	22,300	162.00	3,612,600	
メドピア	13,700	2,056.00	28,167,200	
レアジョブ	4,300	556.00	2,390,800	
リクルートホールディングス	1,380,700	4,330.00	5,978,431,000	
エラン	26,900	1,094.00	29,428,600	
土木管理総合試験所	10,000	328.00	3,280,000	
ネットマーケティング	10,100	562.00	5,676,200	
日本郵政	2,106,000	981.50	2,067,039,000	
ベルシステム２４ホールディングス	27,900	1,414.00	39,450,600	
鎌倉新書	22,600	564.00	12,746,400	
ＳＭＮ	4,800	586.00	2,812,800	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,400	702.00	2,386,800	
エアトリ	11,200	2,318.00	25,961,600	
アトラエ	13,700	1,712.00	23,454,400	
ストライク	8,600	3,615.00	31,089,000	
ソラスト	47,900	751.00	35,972,900	
セラク	6,400	1,285.00	8,224,000	
インソース	21,500	2,425.00	52,137,500	
ベイカレント・コンサルティング	13,600	38,150.00	518,840,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,800	2,534.00	9,629,200	
アイモバイル	9,800	1,381.00	13,533,800	

キャリアインデックス	7,300	538.00	3,927,400	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	8,200	906.00	7,429,200	
船場	4,400	673.00	2,961,200	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	61,400	1,580.00	97,012,000	
フルテック	3,000	1,300.00	3,900,000	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	6,500	527.00	3,425,500	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	3,300	646.00	2,131,800	
ウェルビー	13,200	703.00	9,279,600	
エル・ティー・エス	2,600	3,510.00	9,126,000	
ミダックホールディングス	8,800	2,837.00	24,965,600	
日総工産	15,700	583.00	9,153,100	
キュービーネットホールディングス	9,200	1,347.00	12,392,400	
ＲＰＡホールディングス	28,200	331.00	9,334,200	
スプリックス	6,900	993.00	6,851,700	
マネジメントソリューションズ	9,600	2,728.00	26,188,800	
プロレド・パートナーズ	5,000	488.00	2,440,000	
テノ．ホールディングス	2,900	674.00	1,954,600	
フロンティア・マネジメント	5,300	1,298.00	6,879,400	
ピアラ	3,600	703.00	2,530,800	
コプロ・ホールディングス	4,200	858.00	3,603,600	
ギークス	3,700	1,022.00	3,781,400	
カーブスホールディングス	53,400	685.00	36,579,000	
フォーラムエンジニアリング	12,100	924.00	11,180,400	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	3,800	1,388.00	5,274,400	
ダイレクトマーケティングミックス	19,800	1,835.00	36,333,000	
ポピンズ	4,700	1,888.00	8,873,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	15,800	2,305.00	36,419,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	10,500	447.00	4,693,500	
リログループ	105,600	2,062.00	217,747,200	
東祥	14,700	1,302.00	19,139,400	
ビーウィズ	5,400	1,408.00	7,603,200	
ＴＲＥホールディングス	36,400	1,667.00	60,678,800	
人・夢・技術グループ	7,800	2,471.00	19,273,800	
エイチ・アイ・エス	40,200	2,036.00	81,847,200	
ラックランド	5,900	2,946.00	17,381,400	
共立メンテナンス	34,500	4,760.00	164,220,000	
イチネンホールディングス	20,000	1,253.00	25,060,000	
建設技術研究所	9,900	2,671.00	26,442,900	
スペース	12,900	906.00	11,687,400	
燦ホールディングス	8,600	1,878.00	16,150,800	
スバル興業	1,200	8,660.00	10,392,000	
東京テアトル	7,000	1,227.00	8,589,000	

タナベ経営	7,900	666.00	5,261,400	
ナガワ	5,400	8,190.00	44,226,000	
東京都競馬	14,500	4,015.00	58,217,500	
カナモト	31,700	1,976.00	62,639,200	
西尾レントオール	16,100	2,835.00	45,643,500	
トランス・コスモス	24,500	3,565.00	87,342,500	
乃村工藝社	83,000	898.00	74,534,000	
藤田観光	8,400	2,714.00	22,797,600	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	12,000	1,443.00	17,316,000	
日本管財	20,800	2,621.00	54,516,800	
トーカイ	15,400	1,688.00	25,995,200	
セコム	190,000	8,752.00	1,662,880,000	
セントラル警備保障	9,400	2,681.00	25,201,400	
丹青社	36,800	814.00	29,955,200	
メイテック	68,800	2,345.00	161,336,000	
応用地質	18,600	1,707.00	31,750,200	
船井総研ホールディングス	36,300	2,296.00	83,344,800	
進学会ホールディングス	7,300	320.00	2,336,000	
オオバ	12,500	754.00	9,425,000	
いであ	4,900	1,737.00	8,511,300	
学究社	6,400	1,587.00	10,156,800	
ベネッセホールディングス	64,400	2,281.00	146,896,400	
イオンディライト	22,300	2,845.00	63,443,500	
ナック	9,500	987.00	9,376,500	
ダイセキ	35,200	3,805.00	133,936,000	
ステップ	7,300	1,726.00	12,599,800	
合　計	205,353,800		496,512,658,660	

(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。

日本債券ツイン戦略マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	977,458,704
国債証券	22,446,391,200
社債券	46,881,182,000
コール・オプション（買）	46,851,000
プット・オプション（買）	27,492,000
派生商品評価勘定	5,996,700
未収入金	391,873,000
未収利息	123,949,881
前払費用	4,402,716
差入委託証拠金	14,200,000
流動資産合計	70,919,797,201
資産合計	70,919,797,201
負債の部	
流動負債	
コール・オプション（売）	17,171,000
プット・オプション（売）	35,521,000
前受金	6,000,000
未払金	24,423,000
未払解約金	3,197,313
未払利息	298
流動負債合計	86,312,611
負債合計	86,312,611
純資産の部	
元本等	
元本	73,628,336,848
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△2,794,852,258
元本等合計	70,833,484,590
純資産合計	70,833,484,590
負債純資産合計	70,919,797,201

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、社債券 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。 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。 (1)先物取引

	2022年 7月11日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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、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。 (2)債券店頭オプション取引 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、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。
3.収益及び費用の計上基準	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 7月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	73,628,336,848口
2.	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,794,852,258円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9620円 (1万口当たり純資産額) (9,620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 7月11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 7月11日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引、債券店頭オプション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。債券店頭オプション取引に係る主要なリスクは、オプション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 7月11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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	67,304,440,043円
期中追加設定元本額	16,207,934,019円
期中一部解約元本額	9,884,037,214円
期末元本額	73,628,336,848円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,035,330,425円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,601,363,056円
国内債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	50,038,006,771円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,475,154,242円
債券コア戦略ファンド	786,649,358円
債券コア・セレクション	3,352,877,964円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,385,126,729円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,572,913円
日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,949,546,544円
ＦＯＦｓ用　日本債券ツイン戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,175,163,329円
私募日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	6,784,545,517円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△956,318,900
社債券	△869,293,000
合計	△1,825,611,900

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本債券ツイン戦略マザーファンド」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 7月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,484,100,000	－	1,490,100,000	6,000,000
市場取引以外の取引	債券店頭オプション取引				
	買建				
	コール	11,065,299,000	－	46,851,000	18,376,000
	プット	13,472,627,000	－	27,492,000	12,343,000
	売建				
	コール	13,472,627,000	－	17,171,000	△10,311,000
	プット	11,065,299,000	－	35,521,000	△3,465,000
合計		50,559,952,000	－	1,617,135,000	22,943,000

(注)1.時価の算定方法

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

債券店頭オプション取引の時価については、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額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。

債券店頭オプション取引の契約額等は、行使価格ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第１４９回利付国債（５年）	200,000,000	200,124,000	
	第１５０回利付国債（５年）	400,000,000	400,000,000	
	第１５１回利付国債（５年）	500,000,000	499,645,000	
	第１５２回利付国債（５年）	1,100,000,000	1,103,861,000	
	第２回利付国債（４０年）	410,000,000	501,491,500	

	第４回利付国債（４０年）	150,000,000	184,371,000	
	第１２回利付国債（４０年）	550,000,000	420,337,500	
	第１３回利付国債（４０年）	200,000,000	151,846,000	
	第１４回利付国債（４０年）	600,000,000	487,260,000	
	第３６５回利付国債（１０年）	2,100,000,000	2,076,690,000	
	第３６６回利付国債（１０年）	3,300,000,000	3,298,416,000	
	第２９回利付国債（３０年）	100,000,000	125,821,000	
	第３１回利付国債（３０年）	230,000,000	282,506,700	
	第３４回利付国債（３０年）	150,000,000	183,691,500	
	第３５回利付国債（３０年）	100,000,000	119,073,000	
	第３７回利付国債（３０年）	280,000,000	328,403,600	
	第４１回利付国債（３０年）	450,000,000	510,115,500	
	第４６回利付国債（３０年）	200,000,000	217,886,000	
	第４７回利付国債（３０年）	290,000,000	321,566,500	
	第４８回利付国債（３０年）	80,000,000	85,301,600	
	第５１回利付国債（３０年）	420,000,000	349,377,000	
	第５２回利付国債（３０年）	420,000,000	365,559,600	
	第５５回利付国債（３０年）	80,000,000	74,070,400	
	第５８回利付国債（３０年）	290,000,000	266,437,500	
	第６１回利付国債（３０年）	90,000,000	79,766,100	
	第６４回利付国債（３０年）	470,000,000	380,051,400	
	第６５回利付国債（３０年）	70,000,000	56,740,600	
	第６７回利付国債（３０年）	100,000,000	84,870,000	
	第６９回利付国債（３０年）	370,000,000	321,896,300	
	第７０回利付国債（３０年）	1,200,000,000	1,041,924,000	
	第７１回利付国債（３０年）	250,000,000	216,635,000	
	第７２回利付国債（３０年）	150,000,000	129,718,500	
	第７３回利付国債（３０年）	650,000,000	561,580,500	
	第７４回利付国債（３０年）	800,000,000	747,784,000	
	第１６３回利付国債（２０年）	300,000,000	297,684,000	
	第１６５回利付国債（２０年）	500,000,000	485,660,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	800,000,000	741,432,000	
	第１７１回利付国債（２０年）	360,000,000	330,930,000	
	第１７２回利付国債（２０年）	270,000,000	251,510,400	
	第１７３回利付国債（２０年）	1,050,000,000	974,169,000	
	第１７４回利付国債（２０年）	400,000,000	369,600,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,030,403,000	
	第１７６回利付国債（２０年）	100,000,000	93,302,000	
	第１７７回利付国債（２０年）	150,000,000	136,977,000	
	第１７８回利付国債（２０年）	300,000,000	278,310,000	
	第１７９回利付国債（２０年）	700,000,000	647,241,000	
	第１８０回利付国債（２０年）	650,000,000	634,354,500	

国債証券合計		23,430,000,000	22,446,391,200	
社債券	第６回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	1,000,000,000	1,004,310,000	
	第８回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	600,000,000	600,720,000	
	第２回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約	100,000,000	101,615,000	
	第３回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約	800,000,000	798,720,000	
	第１回大和証券任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	100,000,000	99,250,000	
	第５回Ａ号太陽生命利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,800,000,000	1,799,118,000	
	第３回第一生命ＨＤ利払繰延・任意償還付永久社債（劣後）	500,000,000	493,730,000	
	第４回第一生命ＨＤ利払繰延・任意償還付永久社債（劣後）	200,000,000	194,778,000	
	第１回朝日生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	98,443,000	
	第１回大樹生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	984,360,000	
	第２回ＤＭＧ森精機利払繰延・任意償還付無担保永久社債（劣後）	200,000,000	199,670,000	
	第３回ＤＭＧ森精機利払繰延・任意償還付無担保永久社債（劣後）	300,000,000	309,123,000	
	第４回ＤＭＧ森精機利払繰延・任意償還付無担保永久社債（劣後）	300,000,000	295,749,000	
	第７回クレディ・アグリコル期限前償還非上位円貨社債	200,000,000	201,896,000	
	第２３回ルノー円貨社債	1,000,000,000	989,000,000	
	第２４回ルノー円貨社債	500,000,000	490,475,000	
	第１回大和ハウス工業利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	398,040,000	
	ソシエテ・ジェネラル　０．４７２％　２０２５／０２／２７	200,000,000	196,046,000	
	ＢＮＰパリバ　０．５５７％　２０２７／０５／２０	1,000,000,000	962,570,000	
	第１回アサヒグループＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	1,009,240,000	
	第１回サントリーＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	400,492,000	
	第１回横浜冷凍利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	99,297,000	
	第３回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	200,000,000	197,534,000	
	第５回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	200,000,000	195,770,000	
	第２回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	98,924,000	
	第２回ヒューリック利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	304,053,000	
	第３回ヒューリック利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	301,434,000	

第４回ヒューリック利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	100,693,000	
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	99,136,000	
第１１回日本プロロジスリート投資法人無担保投資法人債	200,000,000	190,780,000	
第１回株式会社オープンハウス無担保社債	200,000,000	199,692,000	
第１回東急不動産ホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特	200,000,000	200,944,000	
第２回東急不動産ホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特	300,000,000	295,269,000	
第５回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	99,126,000	
第４回株式会社マクロミル無担保社債	400,000,000	398,792,000	
第１回住友化学利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	400,140,000	
第２回住友化学利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	600,618,000	
第１回積水化成品工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,326,000	
第１回武田薬品工業利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	204,200,000	
第１回大日本住友製薬利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	300,471,000	
第２回大日本住友製薬利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	99,212,000	
第１７回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,981,000	
第２１回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	193,158,000	
第１回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	102,303,000	
第４回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,200,000,000	1,227,552,000	
第６回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	204,118,000	
第１７回楽天グループ株式会社無担保社債	500,000,000	489,935,000	
第１８回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	94,890,000	
第１９回楽天グループ株式会社無担保社債	200,000,000	189,182,000	
第２０回楽天グループ株式会社無担保社債	300,000,000	276,318,000	
第１回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	500,000,000	496,500,000	
第２回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	500,000,000	484,420,000	
第３回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	600,000,000	589,308,000	
第１回ＪＦＥホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特約付	400,000,000	396,380,000	
第１回ツバキ・ナカシマ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	195,448,000	
第１回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	691,880,000	
	600,000,000	582,630,000	

第２回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）			
第３回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	469,290,000	
第２回かんぽ生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	198,832,000	
第１回アイシン精機利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	297,771,000	
第１回住友生命第１回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	400,000,000	398,964,000	
第３回楽天カード株式会社無担保社債	200,000,000	194,926,000	
第１回日本生命第５回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	600,000,000	590,556,000	
第１回住友生命第２回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	300,000,000	298,668,000	
第１回日本生命第６回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	500,000,000	486,110,000	
第１回明治安田生命第１回劣後ローン流動化利払繰延・期限前（劣	600,000,000	585,372,000	
第１回全共連第１回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣後	500,000,000	487,645,000	
第１回ドンキホーテＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	900,000,000	909,837,000	
第２回シークス株式会社無担保社債	100,000,000	99,422,000	
第１回丸紅利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	199,098,000	
第７回三菱商事利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	297,594,000	
第１回ニプロ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	301,047,000	
第７回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	608,940,000	
第８回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	374,232,000	
第９回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	280,590,000	
第２回東京センチュリー利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	505,460,000	
第３回東京センチュリー利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	300,654,000	
第１９回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,986,000	
第２１回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,298,000	
第２３回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	400,000,000	400,492,000	
第２４回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	400,000,000	399,908,000	
第２５回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	500,000,000	498,565,000	
第２６回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	400,000,000	397,380,000	
	500,000,000	499,950,000	

第２７回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債			
第２８回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	500,000,000	498,620,000	
第６４回アイフル株式会社無担保社債	100,000,000	99,995,000	
第１回オリックス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	297,555,000	
第２回オリックス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	97,055,000	
第１回三菱ＨＣキャピタル利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	299,241,000	
第１回東京海上日動火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,800,000,000	1,782,162,000	
第３回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	500,785,000	
第５回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,200,000,000	1,179,504,000	
第２回Ｔ＆Ｄホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特約付	100,000,000	99,670,000	
第３回Ｔ＆Ｄホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特約付	100,000,000	98,576,000	
第５回三菱地所株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	199,446,000	
第６回三菱地所株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	99,790,000	
第４０回平和不動産株式会社無担保社債	200,000,000	196,332,000	
第３回東京建物利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	198,956,000	
第２６回イオンモール株式会社無担保社債	400,000,000	397,344,000	
第１回株式会社東祥無担保社債	100,000,000	99,883,000	
第１６７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	241,875,000	
第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	242,745,000	
第２回西日本鉄道株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	98,406,000	
第１回商船三井利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	405,580,000	
第１回日本航空株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	695,618,000	
第１０回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	99,682,000	
第４回株式会社ヤマタネ無担保社債	300,000,000	298,323,000	
第９回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	296,232,000	
第１２回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	294,039,000	
第１３回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	288,618,000	
第２３回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	191,644,000	
第２８回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	199,076,000	
第３１回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	187,680,000	
第３３回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	96,137,000	
第３４回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	185,268,000	

	第３６回株式会社光通信無担保社債	400,000,000	380,864,000	
	第３７回株式会社光通信無担保社債	500,000,000	463,805,000	
	第１回GMOインターネット無担保社債	200,000,000	199,644,000	
	第２回GMOインターネット無担保社債	200,000,000	199,096,000	
	第２５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,902,000	
	第３５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,882,000	
	第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,004,000	
	第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	290,262,000	
	第４６回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	289,086,000	
	第４７回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	95,608,000	
	第４９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,959,000	
	第４回ソフトバンクグループ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	197,408,000	
	第４回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債（劣後特約付）	300,000,000	290,481,000	
	第４８回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債	600,000,000	601,998,000	
社債券合計		47,500,000,000	46,881,182,000	
合計			69,327,573,200	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	15,405,048,822
コール・ローン	1,537,103,611
株式	499,448,683,690
投資信託受益証券	214,048,693
投資証券	12,281,758,137
派生商品評価勘定	464,787,926

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
未収入金	19,296,445
未収配当金	472,239,856
差入委託証拠金	2,329,861,387
流動資産合計	532,172,828,567
資産合計	532,172,828,567
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	27,560,732
前受金	433,256,818
未払金	1,752,920
未払解約金	40,338,245
未払利息	469
流動負債合計	502,909,184
負債合計	502,909,184
純資産の部	
元本等	
元本	126,863,910,081
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	404,806,009,302
元本等合計	531,669,919,383
純資産合計	531,669,919,383
負債純資産合計	532,172,828,567

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (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。 (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。 (1)先物取引

	2022年 7月11日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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。 (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。 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。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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。 (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 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	126,863,910,081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　4.1909円 (1万口当たり純資産額)　(41,909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 7月11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 7月11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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	137,442,391,078円
期中追加設定元本額	17,019,323,173円
期中一部解約元本額	27,597,804,170円
期末元本額	126,863,910,081円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,894,889,318円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,452,610円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	32,516,161,572円
世界経済インデックスファンド	10,760,805,521円
外国株式インデックス・オープン	884,934,839円
ＤＣマイセレクション２５	803,309,678円
ＤＣマイセレクション５０	3,647,379,804円
ＤＣマイセレクション７５	4,418,518,110円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	11,925,136,621円
ＤＣマイセレクションＳ２５	407,078,620円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,866,378,891円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,572,262,911円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	45,877,828円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	165,178,377円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	120,833,747円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,885,280,249円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,464,597,079円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,636,069円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,723,159円

区分	2022年 7月11日現在
外国株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	27,832,912円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	14,652,788円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	51,512,025円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	11,591,757円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	31,949,096円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	275,499,270円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	174,614,100円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,272,821,926円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	114,301,598円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	24,546,389円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	161,383,049円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	55,395,833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）	1,116,052,687円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,136,329,338円
コア投資戦略ファンド（安定型）	581,693,447円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,362,981,916円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,498,580,570円
分散投資コア戦略ファンドＳ	8,324,445,284円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,328,248,883円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,119,523,787円
コア投資戦略ファンド（切替型）	574,095,237円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	597,135,733円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,611,078円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	157,885,757円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	376,694,058円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	16,343,591,891円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	196,810,461円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	755,387,224円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	138,729,755円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,798,123円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	175,694,765円
グローバル経済コア	647,778,934円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	13,596,169円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	5,595,885円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	205,869,265円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	78,132,978円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	50,215,861円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	40,627,233円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	15,422,653円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	19,583,968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）	265,676,388円

区分	2022年 7月11日現在
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）	186,316,815円
外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	873,381,106円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,269,644,656円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	209,973,912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）	86,923,126円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	61,083,062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）	58,795,703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）	115,406,823円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△32,455,259,824
投資信託受益証券	△8,172,061
投資証券	△969,649,024
合計	△33,433,080,909

(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 7月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	19,200,398,532	－	19,633,655,350	433,256,818
合計		19,200,398,532	－	19,633,655,350	433,256,818

(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 7月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,448,124,700	－	1,452,095,076	3,970,376
	アメリカドル	1,082,798,800	－	1,086,234,336	3,435,536
	カナダドル	125,965,200	－	126,411,720	446,520
	ユーロ	124,667,100	－	124,731,270	64,170
	イギリスポンド	114,693,600	－	114,717,750	24,150
合計		1,448,124,700	－	1,452,095,076	3,970,376

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

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	34.85	964,334.35	
	BAKER HUGHES CO	75,948	28.47	2,162,239.56	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	127.86	2,332,549.98	
	CHEVRON CORP	155,015	142.77	22,131,491.55	
	CONOCOPHILLIPS	104,031	86.46	8,994,520.26	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	26.31	1,683,840.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	54.48	2,737,946.88	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	116.33	1,543,350.11	
	EOG RESOURCES INC	46,119	105.52	4,866,476.88	
	EQT CORPORATION	27,026	34.20	924,289.20	
	EXXON MOBIL	336,966	86.08	29,006,033.28	
	HALLIBURTON CO	71,583	29.84	2,136,036.72	
	HESS CORP	22,781	100.18	2,282,200.58	

KINDER MORGAN INC	159,310	16.97	2,703,490.70	
MARATHON OIL CORP	57,281	21.72	1,244,143.32	
MARATHON PETROLEUM CORP	45,012	83.27	3,748,149.24	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	74,379	60.67	4,512,573.93	
ONEOK INC	35,533	56.82	2,018,985.06	
PHILLIPS 66	38,237	82.01	3,135,816.37	
PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	217.50	3,963,720.00	
SCHLUMBERGER	112,526	34.32	3,861,892.32	
TARGA RESOURCES CORP	17,298	59.72	1,033,036.56	
VALERO ENERGY CORP	32,597	107.03	3,488,856.91	
WILLIAMS COS	98,553	31.32	3,086,679.96	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	232.21	4,073,195.61	
ALBEMARLE CORP	9,440	205.93	1,943,979.20	
ALCOA CORP	15,500	44.83	694,865.00	
AMCOR PLC	111,485	12.44	1,386,873.40	
AVERY DENNISON CORP	6,638	164.95	1,094,938.10	
BALL CORP	25,605	68.62	1,757,015.10	
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	112.99	969,680.18	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	86.00	1,421,322.00	
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	15.47	665,210.00	
CORTEVA INC	58,500	52.73	3,084,705.00	
CROWN HOLDINGS INC	9,940	88.84	883,069.60	
DOW INC	57,346	51.38	2,946,437.48	
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	55.44	2,271,931.20	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	90.19	998,854.25	
ECOLAB INC	19,895	155.61	3,095,860.95	
FMC CORP	10,507	104.93	1,102,499.51	
FREEPORT-MCMORAN INC	113,194	28.00	3,169,432.00	
INT'L PAPER CO	30,800	42.71	1,315,468.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,494	116.58	2,272,610.52	
LINDE PLC	40,861	273.68	11,182,838.48	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,803	87.48	1,732,366.44	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,631	307.44	1,423,754.64	
MOSAIC CO/THE	27,732	45.22	1,254,041.04	
NEWMONT CORPORATION	61,555	59.36	3,653,904.80	
NUCOR CORP	22,299	109.01	2,430,813.99	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	139.81	1,074,719.47	
PPG INDUSTRIES INC	19,278	117.87	2,272,297.86	
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	79.98	836,270.88	
SEALED AIR CORP	11,690	56.29	658,030.10	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	238.29	4,698,840.51	
STEEL DYNAMICS INC	15,552	66.16	1,028,920.32	

VULCAN MATERIALS CO	10,247	146.41	1,500,263.27	
WESTLAKE CORP	4,100	97.02	397,782.00	
WESTROCK CO	21,356	40.35	861,714.60	
3 M COMPANY	44,860	128.72	5,774,379.20	
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	39.28	432,276.40	
ALLEGION PLC	7,601	98.54	749,002.54	
AMETEK INC	18,006	112.35	2,022,974.10	
BOEING CO	43,246	139.07	6,014,221.22	
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	36.07	2,458,459.06	
CATERPILLAR	42,499	179.10	7,611,570.90	
CUMMINS INC	11,214	200.53	2,248,743.42	
DEERE&CO	23,252	304.64	7,083,489.28	
DOVER CORP	10,672	121.78	1,299,636.16	
EATON CORP	31,624	127.82	4,042,179.68	
EMERSON ELECTRIC CO	46,305	80.67	3,735,424.35	
FASTENAL CO	44,846	50.64	2,271,001.44	
FORTIVE CORP	25,722	56.01	1,440,689.22	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	61.84	637,570.40	
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	230.56	1,201,448.16	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	221.11	4,194,456.70	
GENERAL ELECTRIC CO	87,527	63.25	5,536,082.75	
GRAINGER (WW) INC	3,667	475.13	1,742,301.71	
HEICO CORP	3,640	133.34	485,357.60	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	107.63	694,105.87	
HONEYWELL INTL INC	54,596	173.34	9,463,670.64	
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	32.74	1,034,387.56	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	215.68	759,624.96	
IDEX CORP	5,916	185.69	1,098,542.04	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,918	182.27	4,541,803.86	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	42.45	1,339,806.90	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	51.88	918,276.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	47.27	2,679,689.03	
KORNIT DIGITAL LTD	2,776	26.14	72,564.64	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	238.17	3,735,458.28	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	214.49	541,801.74	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,332	420.35	8,126,206.20	
MASCO CORP	19,462	52.56	1,022,922.72	
NORDSON CORP	4,121	207.43	854,819.03	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,737	480.43	5,638,806.91	
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	69.89	2,366,335.62	
OWENS CORNING	8,642	79.50	687,039.00	
PACCAR INC	28,106	81.07	2,278,553.42	

PARKER HANNIFIN CORP	9,900	248.04	2,455,596.00	
PENTAIR PLC	14,533	46.50	675,784.50	
PLUG POWER INC	41,884	19.77	828,046.68	
QUANTA SERVICES INC	11,465	131.95	1,512,806.75	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	118,799	95.12	11,300,160.88	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	200.13	1,820,782.74	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	41.57	574,829.96	
SMITH (A.O.) CORP	9,016	56.97	513,641.52	
SNAP-ON INC	4,000	198.02	792,080.00	
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	110.28	1,389,307.44	
TEXTRON	16,934	61.06	1,033,990.04	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	131.08	2,443,069.04	
TRANSDIGM GROUP INC	4,075	536.66	2,186,889.50	
UNITED RENTALS INC	5,393	248.86	1,342,101.98	
WABTEC CORP	15,024	83.02	1,247,292.48	
XYLEM INC	13,269	78.76	1,045,066.44	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	92.54	1,051,624.56	
CINTAS CORP	7,423	381.07	2,828,682.61	
CLARIVATE PLC	27,357	14.19	388,195.83	
COPART INC	16,617	114.49	1,902,480.33	
COSTAR GROUP INC	32,116	61.80	1,984,768.80	
EQUIFAX INC	9,509	190.45	1,810,989.05	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	126.09	1,344,245.49	
LEIDOS HOLDINGS	11,220	101.63	1,140,288.60	
REPUBLIC SERVICES INC	16,942	129.86	2,200,088.12	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	78.52	751,122.32	
ROLLINS INC	17,468	36.71	641,250.28	
TRANSUNION	15,741	82.77	1,302,882.57	
VERISK ANALYTICS INC	12,503	178.07	2,226,409.21	
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	125.51	2,670,225.25	
WASTE MANAGEMENT INC	32,770	152.76	5,005,945.20	
AMERCO	734	473.58	347,607.72	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	100.26	1,030,372.02	
CSX CORP	173,146	28.99	5,019,502.54	
DELTA AIR LINES INC	14,609	29.72	434,179.48	
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	97.24	1,387,809.28	
FEDEX CORP	20,314	230.49	4,682,173.86	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	2.50	207,527.50	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	165.70	1,168,516.40	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	48.21	515,847.00	
LYFT INC-A	21,288	13.40	285,259.20	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	226.20	4,317,479.40	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	273.02	2,184,979.06	
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	36.70	496,661.10	
UBER TECHNOLOGIES INC	113,645	22.34	2,538,829.30	
UNION PACIFIC CORP	50,721	209.70	10,636,193.70	
UNITED PARCEL SERVICE B	58,317	185.40	10,811,971.80	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	44.55	319,646.25	
APTIV PLC	20,714	92.46	1,915,216.44	
BORGWARNER INC	19,781	34.45	681,455.45	
FORD MOTOR COMPANY	305,209	11.62	3,546,528.58	
GENERAL MOTORS CO	109,933	32.31	3,551,935.23	
LEAR CORP	5,287	128.20	677,793.40	
LUCID GROUP INC	31,234	19.99	624,367.66	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	31.99	427,482.37	
TESLA INC	69,919	752.29	52,599,364.51	
DR HORTON INC	27,764	73.36	2,036,767.04	
GARMIN LTD	12,854	102.98	1,323,704.92	
HASBRO INC	10,572	83.79	885,827.88	
LENNAR CORP-CL A	20,844	78.39	1,633,961.16	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	293.39	2,729,993.95	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	123.92	515,878.96	
NEWELL BRANDS INC	31,461	19.32	607,826.52	
NIKE B	101,600	107.93	10,965,688.00	
NVR INC	247	4,370.80	1,079,587.60	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	10.21	221,924.56	
PULTE GROUP INC	21,609	44.20	955,117.80	
VF CORP	25,718	45.83	1,178,655.94	
WHIRLPOOL CORP	5,220	160.81	839,428.20	
AIRBNB INC-CLASS A	26,610	97.35	2,590,483.50	
ARAMARK	20,955	30.54	639,965.70	
BOOKING HOLDINGS INC	3,255	1,769.48	5,759,657.40	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	39.59	695,200.40	
CARNIVAL CORPORATION	62,102	9.01	559,539.02	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,164	1,339.28	2,898,201.92	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	116.78	1,250,947.36	
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	401.35	1,143,044.80	
EXPEDIA GROUP INC	11,638	94.87	1,104,097.06	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	111.59	2,441,366.02	
LAS VEGAS SANDS CORP	24,370	34.38	837,840.60	
MARRIOTT INTL A	22,091	137.80	3,044,139.80	
MCDONALD'S CORP	59,191	253.24	14,989,528.84	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	29.34	847,163.16	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	34.44	577,455.48	

STARBUCKS CORP	91,531	79.28	7,256,577.68	
VAIL RESORTS INC	3,014	216.12	651,385.68	
WYNN RESORTS LTD	9,302	56.46	525,190.92	
YUM BRANDS INC	22,637	117.28	2,654,867.36	
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	78.13	4,816,167.59	
ALPHABET INC-CL A	23,937	2,387.07	57,139,294.59	
ALPHABET INC-CL C	22,610	2,403.37	54,340,195.70	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	14.66	561,331.40	
CABLE ONE INC	445	1,337.77	595,307.65	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	463.55	4,546,961.95	
COMCAST CORP-CL A	360,096	39.96	14,389,436.16	
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	18.34	369,220.88	
ELECTRONIC ARTS INC	21,814	125.63	2,740,492.82	
FOX CORP - CLASS A	27,658	33.24	919,351.92	
FOX CORP- CLASS B	10,345	30.63	316,867.35	
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	78.80	529,614.80	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	28.18	953,442.12	
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	116.64	1,314,299.52	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	61.05	938,887.95	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	36.63	497,581.92	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	36.73	234,484.32	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,343	84.36	1,041,255.48	
MATCH GROUP INC	22,730	75.24	1,710,205.20	
META PLATFORMS INC-CLASS A	183,787	170.88	31,405,522.56	
NETFLIX INC	35,348	186.97	6,609,192.30	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	15.75	527,294.25	
OMNICOM GROUP	16,538	64.46	1,066,039.48	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	25.56	1,241,858.16	
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	20.24	926,324.08	
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	41.25	1,157,433.75	
ROKU INC	9,122	94.41	861,208.02	
SEA LTD-ADR	28,338	77.52	2,196,761.76	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.31	381,553.08	
SNAP INC - A	83,375	14.96	1,247,290.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	12,867	124.93	1,607,474.31	
THE WALT DISNEY CO	144,924	95.86	13,892,414.64	
TWITTER INC	63,066	36.81	2,321,459.46	
WARNER BROS DISCOVERY INC	175,398	13.99	2,453,818.02	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	36.65	803,917.75	
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	182.90	973,759.60	
AMAZON.COM	728,980	115.54	84,226,349.20	
AUTOZONE INC	1,639	2,182.37	3,576,904.43	

BATH & BODY WORKS INC	19,806	27.62	547,041.72	
BEST BUY COMPANY INC	18,175	71.17	1,293,514.75	
BURLINGTON STORES INC	5,108	152.20	777,437.60	
CARMAX INC	12,051	92.66	1,116,645.66	
CARVANA CO	5,700	25.09	143,013.00	
CHEWY INC - CLASS A	6,878	44.13	303,526.14	
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	252.88	4,725,315.68	
DOLLAR TREE INC	17,931	167.36	3,000,932.16	
DOORDASH INC - A	15,171	74.96	1,137,218.16	
EBAY	46,820	43.14	2,019,814.80	
ETSY INC	10,294	88.75	913,592.50	
GENUINE PARTS CO	11,319	137.14	1,552,287.66	
HOME DEPOT	83,117	286.47	23,810,526.99	
LKQ CORP	22,779	51.22	1,166,740.38	
LOWES COMPANIES	53,337	181.63	9,687,599.31	
MERCADOLIBRE INC	3,567	708.63	2,527,683.21	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	657.88	3,557,157.16	
POOL CORP	3,304	378.21	1,249,605.84	
ROSS STORES INC	28,076	75.46	2,118,614.96	
TARGET (DAYTON HUDSON)	38,149	147.99	5,645,670.51	
TJX COMPANIES INC	94,981	58.94	5,598,180.14	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	203.96	1,819,731.12	
ULTA BEAUTY INC	4,315	381.44	1,645,913.60	
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	55.31	331,860.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	35,297	501.54	17,702,857.38	
KROGER CO	56,126	48.02	2,695,170.52	
SYSCO CORP	40,288	86.15	3,470,811.20	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	37.55	2,244,250.85	
WALMART INC	121,442	125.40	15,228,826.80	
ALTRIA GROUP INC	142,972	41.52	5,936,197.44	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,772	73.34	3,283,578.48	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	70.16	1,684,260.96	
BUNGE LIMITED	11,604	87.70	1,017,670.80	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	48.58	770,916.02	
COCA-COLA CO	327,837	63.14	20,699,628.18	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	51.80	797,409.20	
CONAGRA BRANDS INC	35,941	35.31	1,269,076.71	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	242.17	3,133,679.80	
GENERAL MILLS INC	46,541	75.54	3,515,707.14	
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,352	219.79	2,495,056.08	
HORMEL FOODS CORP	23,338	47.55	1,109,721.90	
JM SMUCKER CO	9,145	131.95	1,206,682.75	

KELLOGG CO	21,630	72.52	1,568,607.60	
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	36.20	2,250,011.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	58,511	38.37	2,245,067.07	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,909	82.07	1,551,861.63	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	55.50	814,129.50	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	110,537	62.44	6,901,930.28	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	97.48	3,145,387.16	
PEPSICO INC	110,121	171.88	18,927,597.48	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	123,371	93.89	11,583,303.19	
TYSON FOODS INC	23,306	84.11	1,960,267.66	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	94.71	1,832,259.66	
CLOROX COMPANY	9,570	141.36	1,352,815.20	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	78.35	4,997,789.80	
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,438	251.48	4,636,788.24	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,841	134.20	3,602,062.20	
PROCTER & GAMBLE CO	190,793	145.02	27,668,800.86	
ABBOTT LABORATORIES	140,374	109.26	15,337,263.24	
ABIOMED INC	3,781	267.00	1,009,527.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	261.52	1,554,213.36	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	142.55	1,838,324.80	
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	65.18	2,608,047.34	
BECTON DICKINSON & CO	22,232	245.66	5,461,513.12	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,802	37.84	4,268,427.68	
CARDINAL HEALTH	21,902	52.92	1,159,053.84	
CENTENE CORP	46,422	88.01	4,085,600.22	
CIGNA CORP	25,554	279.19	7,134,421.26	
CVS HEALTH CORP	104,487	94.18	9,840,585.66	
DAVITA INC	4,627	83.12	384,596.24	
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	35.21	625,822.54	
DEXCOM INC	30,588	81.24	2,484,969.12	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49,627	98.39	4,882,800.53	
ELEVANCE HEALTH INC	19,210	484.29	9,303,210.90	
HCA HEALTHCARE INC	19,440	172.60	3,355,344.00	
HENRY SCHEIN INC	11,747	76.88	903,109.36	
HOLOGIC INC	19,018	71.38	1,357,504.84	
HUMANA INC	9,953	483.38	4,811,081.14	
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	378.45	2,554,915.95	
INSULET CORP	5,311	235.51	1,250,793.61	
INTUITIVE SURGICAL INC	28,484	208.81	5,947,744.04	
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	243.94	1,852,724.30	
MASIMO CORP	4,147	136.50	566,065.50	
MCKESSON CORP	12,089	331.20	4,003,876.80	

MEDTRONIC PLC	106,878	89.48	9,563,443.44	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	285.21	1,296,279.45	
NOVOCURE LTD	7,933	74.42	590,373.86	
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	135.74	1,358,078.70	
RESMED INC	11,440	217.67	2,490,144.80	
STERIS PLC	8,018	209.40	1,678,969.20	
STRYKER CORP	27,055	200.88	5,434,808.40	
TELADOC HEALTH INC	11,375	41.81	475,588.75	
TELEFLEX INC	3,934	254.66	1,001,832.44	
THE COOPER COS INC	4,134	311.57	1,288,030.38	
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,889	518.63	38,839,682.07	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	103.44	631,190.88	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	210.05	2,364,112.75	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	105.34	1,715,040.54	
ABBVIE INC	140,788	152.85	21,519,445.80	
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	122.51	2,913,900.35	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	152.49	1,470,461.07	
AMGEN	44,045	248.48	10,944,301.60	
AVANTOR INC	48,633	31.41	1,527,562.53	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	517.12	958,223.36	
BIO-TECHNE CORP	3,245	369.93	1,200,422.85	
BIOGEN INC	11,860	218.80	2,594,968.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	89.02	1,315,982.66	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	172,791	75.38	13,024,985.58	
CATALENT INC	13,739	111.81	1,536,157.59	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	231.42	972,889.68	
DANAHER CORP	54,097	263.76	14,268,624.72	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	20.45	737,447.45	
EXACT SCIENCES CORP	14,756	46.58	687,334.48	
GILEAD SCIENCES INC	99,836	62.84	6,273,694.24	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	83.61	1,498,792.86	
ILLUMINA INC	12,506	197.04	2,464,182.24	
INCYTE CORP	15,212	80.48	1,224,261.76	
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	219.34	3,317,736.84	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	158.30	786,909.30	
JOHNSON & JOHNSON	209,270	178.28	37,308,655.60	
LILLY (ELI) & CO	64,434	330.47	21,293,503.98	
MERCK & CO	201,204	92.78	18,667,707.12	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,221.28	2,208,074.24	
MODERNA INC	27,309	176.23	4,812,665.07	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	95.57	809,860.18	
PERKINELMER INC	9,372	146.01	1,368,405.72	

PFIZER	447,595	53.17	23,798,626.15	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,497	621.57	5,281,480.29	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	42.96	1,122,458.88	
SEAGEN INC	10,981	177.45	1,948,578.45	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	7.44	598,183.44	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,139	553.71	17,241,975.69	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,030	294.29	5,894,628.70	
VIATRIS INC	90,748	10.35	939,241.80	
WATERS CORP	4,749	346.25	1,644,341.25	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	318.48	1,836,674.16	
ZOETIS INC	37,579	177.98	6,688,310.42	
BANK OF AMERICA CORP	576,261	31.79	18,319,337.19	
CITIGROUP	157,983	46.82	7,396,764.06	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	36.31	1,435,043.82	
FIFTH THIRD BANCORP	52,803	33.86	1,787,909.58	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	681.95	647,852.50	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	150.94	2,081,009.78	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	12.27	1,400,154.24	
JPMORGAN CHASE & CO	235,026	114.36	26,877,573.36	
KEY CORP	71,472	17.49	1,250,045.28	
M & T BANK CORP	14,037	158.92	2,230,760.04	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,936	161.38	5,315,211.68	
REGIONS FINL CORP	70,814	19.02	1,346,882.28	
SIGNATURE BANK	4,686	193.46	906,553.56	
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	418.63	1,902,673.35	
TRUIST FINANCIAL CORP	105,758	47.70	5,044,656.60	
US BANCORP	112,247	46.53	5,222,852.91	
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	43.34	618,591.82	
WELLS FARGO & CO	303,649	40.18	12,200,616.82	
ALLY FINANCIAL INC	27,761	34.74	964,417.14	
AMERICAN EXPRESS	51,483	141.76	7,298,230.08	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	236.53	2,058,284.06	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	51.56	1,642,392.24	
BANK NEW YORK CO	61,254	41.89	2,565,930.06	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	102,772	280.83	28,861,460.76	
BLACKROCK INC	12,105	619.56	7,499,773.80	
BLACKSTONE INC	55,765	96.14	5,361,247.10	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	108.61	3,611,934.16	
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	31.99	501,251.31	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	118.51	1,051,776.25	
CME GROUP INC	28,617	208.90	5,978,091.30	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	60.29	577,337.04	

DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	100.21	2,345,214.63	
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,355	25.97	710,409.35	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	401.63	1,264,331.24	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	23.87	622,290.90	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	51.42	221,928.72	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,636	296.47	7,896,774.92	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	95.87	4,285,676.61	
INVESCO LTD	26,420	16.21	428,268.20	
KKR & CO INC	44,282	47.55	2,105,609.10	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	181.84	1,161,230.24	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	266.11	853,414.77	
MOODY'S CORP	13,365	284.13	3,797,397.45	
MORGAN STANLEY	106,388	76.73	8,163,151.24	
MSCI INC	6,518	433.95	2,828,486.10	
NASDAQ INC	9,657	156.56	1,511,899.92	
NORTHERN TRUST CORP	15,902	96.61	1,536,292.22	
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	115.96	2,076,495.72	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	90.68	1,404,270.48	
S&P GLOBAL INC	28,197	352.48	9,938,878.56	
SCHWAB (CHARLES) CORP	115,365	64.36	7,424,891.40	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	54.64	521,812.00	
STATE STREET CORP	27,998	63.03	1,764,713.94	
SYNCHRONY FINANCIAL	41,566	29.68	1,233,678.88	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	70.61	639,797.21	
UPSTART HOLDINGS INC	3,148	27.09	85,279.32	
AFLAC	50,591	56.25	2,845,743.75	
ALLEGHANY CORP	1,080	834.57	901,335.60	
ALLSTATE CORP	22,174	130.87	2,901,911.38	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	137.95	871,706.05	
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	51.47	3,391,770.06	
AON PLC	17,038	274.37	4,674,716.06	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	44.47	1,321,915.22	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	166.76	2,728,026.84	
ASSURANT INC	4,726	175.09	827,475.34	
BROWN & BROWN INC	19,873	60.08	1,193,969.84	
CHUBB LTD	33,670	193.07	6,500,666.90	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	118.64	1,517,524.24	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	195.76	424,016.16	
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	280.72	923,007.36	
FNF GROUP	20,461	37.12	759,512.32	
GLOBE LIFE INC	8,106	99.27	804,682.62	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	65.67	1,820,438.07	

LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	47.36	638,602.24	
LOEWS CORP	16,741	57.93	969,806.13	
MARKEL CORP	1,156	1,296.51	1,498,765.56	
MARSH & MCLENNAN COS	40,031	155.59	6,228,423.29	
METLIFE INC	57,127	62.63	3,577,864.01	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	66.92	1,386,515.48	
PROGRESSIVE CORP	46,534	120.38	5,601,762.92	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,511	96.31	2,842,204.41	
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	169.00	3,341,468.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,385	201.27	1,888,918.95	
WR BERKLEY CORP	17,572	67.31	1,182,771.32	
CBRE GROUP INC-A	25,382	75.85	1,925,224.70	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.01	494,487.00	
WEYERHAEUSER CO	58,295	35.01	2,040,907.95	
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	35.14	471,824.78	
ACCENTURE PLC-CL A	50,581	279.07	14,115,639.67	
ADOBE INC	37,548	389.44	14,622,693.12	
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	23.34	299,125.44	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	13,673	92.15	1,259,966.95	
ANSYS INC	6,794	249.65	1,696,122.10	
APPLOVIN CORP-CLASS A	10,000	37.39	373,900.00	
AUTODESK INC	17,467	179.83	3,141,090.61	
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,443	217.27	7,266,160.61	
AVALARA INC	6,847	87.66	600,208.02	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	36.00	503,856.00	
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	129.89	966,771.27	
BLACK KNIGHT INC	11,543	65.19	752,488.17	
BLOCK INC	41,288	67.02	2,767,121.76	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	149.30	1,454,480.60	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,922	160.42	3,516,727.24	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	52.20	556,869.60	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	127.16	1,033,047.84	
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	99.22	1,036,253.68	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	52.08	1,056,338.64	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,421	67.02	2,709,015.42	
COUPA SOFTWARE INC	6,059	63.61	385,412.99	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,760	190.38	3,000,388.80	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	139.63	432,853.00	
DATADOG INC - CLASS A	17,059	108.29	1,847,319.11	
DOCUSIGN INC	14,969	66.45	994,690.05	
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	22.74	524,566.32	
DYNATRACE INC	14,790	42.01	621,327.90	

EPAM SYSTEMS INC	4,403	321.02	1,413,451.06	
FAIR ISAAC CORP	2,125	418.85	890,056.25	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	48,175	94.38	4,546,756.50	
FISERV INC	49,921	93.06	4,645,648.26	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	218.45	1,311,136.90	
FORTINET INC	53,225	62.70	3,337,207.50	
GARTNER INC	6,340	242.63	1,538,274.20	
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	113.28	2,556,389.76	
GODADDY INC - CLASS A	13,798	73.00	1,007,254.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	75.45	476,693.10	
HUBSPOT INC	3,646	305.80	1,114,946.80	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,112	140.47	10,129,572.64	
INTUIT INC	21,247	406.81	8,643,492.07	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	185.57	1,167,420.87	
MASTERCARD INC-CLASS A	69,486	323.06	22,448,147.16	
MICROSOFT CORP	567,129	267.66	151,797,748.14	
MONGODB INC	5,325	314.16	1,672,902.00	
NORTONLIFELOCK INC	43,549	23.07	1,004,675.43	
OKTA INC	11,505	103.90	1,195,369.50	
ORACLE CORP	128,255	71.87	9,217,686.85	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	10.17	1,273,731.48	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,648	524.22	4,009,234.56	
PAYCHEX INC	25,433	116.80	2,970,574.40	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	323.29	1,369,133.15	
PAYPAL HOLDINGS INC	88,224	73.43	6,478,288.32	
PTC INC	8,304	106.90	887,697.60	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	56.92	363,889.56	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,314	402.02	3,342,394.28	
SALESFORCE INC	78,410	175.50	13,760,955.00	
SERVICENOW INC	15,923	494.15	7,868,350.45	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,606	159.68	2,651,646.08	
SPLUNK INC	13,355	99.71	1,331,627.05	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	59.97	1,159,519.95	
SYNOPSYS INC	12,038	317.54	3,822,546.52	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,090	45.63	1,509,896.70	
TWILIO INC - A	12,842	92.71	1,190,581.82	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	346.49	1,156,930.11	
UNITY SOFTWARE INC	16,329	45.23	738,560.67	
VERISIGN INC	7,790	178.63	1,391,527.70	
VISA INC-CLASS A SHARES	132,437	203.57	26,960,200.09	
VMWARE INC-CLASS A	16,717	113.60	1,899,051.20	
WESTERN UNION CO	29,297	16.55	484,865.35	

WIX.COM LTD	5,010	70.50	353,205.00	
WORKDAY INC-CLASS A	15,615	148.01	2,311,176.15	
ZENDESK INC	8,890	74.61	663,282.90	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	119.80	2,039,954.40	
ZSCALER INC	6,234	166.89	1,040,392.26	
AMPHENOL CORPORATION	47,707	65.88	3,142,937.16	
APPLE INC	1,298,829	147.04	190,979,816.16	
ARISTA NETWORKS INC	18,880	103.00	1,944,640.00	
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	111.91	682,651.00	
CDW CORP/DE	10,882	161.53	1,757,769.46	
CISCO SYSTEMS	332,253	43.39	14,416,457.67	
COGNEX CORP	14,352	44.74	642,108.48	
CORNING	64,989	32.61	2,119,291.29	
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	42.92	964,884.52	
F5 INC	4,851	157.86	765,778.86	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	98,742	13.19	1,302,406.98	
HP INC	83,910	32.11	2,694,350.10	
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	28.79	728,991.59	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	142.66	2,138,330.74	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,961	214.65	2,782,078.65	
NETAPP INC	18,303	65.04	1,190,427.12	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	74.87	1,241,569.21	
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	115.04	2,998,862.72	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	384.16	1,497,839.84	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	59.76	1,265,477.76	
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	45.24	1,166,739.60	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	299.52	1,246,602.24	
AT&T INC	568,609	20.80	11,827,067.20	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	21.15	328,163.40	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	22.17	609,386.79	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	10.81	797,442.89	
T-MOBILE US INC	49,657	135.72	6,739,448.04	
VERIZON COMMUNICATIONS	334,145	50.49	16,870,981.05	
AES CORP	54,375	21.50	1,169,062.50	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	57.34	1,191,410.52	
AMEREN CORPORATION	20,898	87.75	1,833,799.50	
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,156	94.34	3,788,317.04	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	150.86	2,138,289.64	
ATMOS ENERGY CORP	10,802	112.05	1,210,364.10	
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	29.37	1,414,517.94	
CMS ENERGY CORP	23,697	66.02	1,564,475.94	
CONSOLIDATED EDISON INC	27,507	91.97	2,529,818.79	

CONSTELLATION ENERGY	25,732	59.65	1,534,913.80	
DOMINION ENERGY INC	64,535	79.38	5,122,788.30	
DTE ENERGY COMPANY	15,851	124.85	1,978,997.35	
DUKE ENERGY CORP	61,255	105.91	6,487,517.05	
EDISON INTL	30,339	62.47	1,895,277.33	
ENTERGY CORP	16,181	110.09	1,781,366.29	
ESSENTIAL UTILITIES INC	17,002	46.45	789,742.90	
EVERGY INC	18,475	64.40	1,189,790.00	
EVERSOURCE ENERGY	26,753	83.32	2,229,059.96	
EXELON CORP	77,196	44.29	3,419,010.84	
FIRSTENERGY CORP	41,156	37.13	1,528,122.28	
NEXTERA ENERGY INC	156,245	80.25	12,538,661.25	
NISOURCE INC	32,351	28.47	921,032.97	
NRG ENERGY INC	19,068	37.83	721,342.44	
PG&E CORP	118,132	10.27	1,213,215.64	
PPL CORPORATION	58,459	27.18	1,588,915.62	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	62.46	2,465,171.28	
SEMPRA ENERGY	24,535	147.27	3,613,269.45	
SOUTHERN CO	84,113	71.19	5,988,004.47	
UGI CORP	18,019	39.26	707,425.94	
VISTRA CORP	37,797	22.08	834,557.76	
WEC ENERGY GROUP INC	24,561	99.51	2,444,065.11	
XCEL ENERGY INC	43,741	69.60	3,044,373.60	
ADVANCED MICRO DEVICES	130,137	79.35	10,326,370.95	
ANALOG DEVICES	41,625	149.94	6,241,252.50	
APPLIED MATERIALS	70,331	91.19	6,413,483.89	
BROADCOM INC	32,460	498.69	16,187,477.40	
ENPHASE ENERGY INC	10,113	216.45	2,188,958.85	
ENTEGRIS INC	10,491	91.49	959,821.59	
INTEL CORP	324,141	37.99	12,314,116.59	
KLA CORP	12,119	316.84	3,839,783.96	
LAM RESEARCH CORP	10,992	415.12	4,562,999.04	
MARVELL TECHNOLOGY INC	67,204	46.99	3,157,915.96	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	59.45	2,632,981.05	
MICRON TECHNOLOGY	89,159	59.14	5,272,863.26	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	395.48	1,396,439.88	
NVIDIA CORP	199,119	158.38	31,536,467.22	
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	154.28	3,216,429.44	
ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	53.47	1,843,003.96	
QORVO INC	8,556	99.41	850,551.96	
QUALCOMM	90,300	136.01	12,281,703.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	97.87	1,308,717.64	

	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,214	295.11	1,243,593.54	
	TERADYNE INC	12,318	92.08	1,134,241.44	
	TEXAS INSTRUMENTS	73,796	155.53	11,477,491.88	
アメリカドル 小計		26,193,313		2,699,305,834.30 (368,374,267,206)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	15.50	850,330.00	
	CAMECO CORP	31,793	28.86	917,545.98	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	63.94	5,958,824.36	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	23.34	2,597,578.62	
	ENBRIDGE	161,329	54.67	8,819,856.43	
	IMPERIAL OIL	16,573	57.49	952,781.77	
	KEYERA CORP	18,607	29.98	557,837.86	
	PARKLAND CORP	14,075	35.26	496,284.50	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	46.25	2,112,052.50	
	SUNCOR ENERGY	116,208	42.43	4,930,705.44	
	TC ENERGY CORP	77,328	67.04	5,184,069.12	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	66.37	1,659,847.33	
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	58.53	2,127,799.62	
	BARRICK GOLD CORP	139,009	22.27	3,095,730.43	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	63.19	830,253.41	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	25.00	1,075,000.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	172.11	2,644,125.93	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	7.58	393,000.26	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	4.35	471,761.85	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	7.92	492,964.56	
	NUTRIEN LTD	44,786	98.83	4,426,200.38	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	24.49	450,885.39	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	34,747	35.76	1,242,552.72	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	104.79	639,219.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	45.59	1,560,910.42	
	CAE INC	25,999	31.95	830,668.05	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	104.30	791,115.50	
	WSP GLOBAL INC	8,602	145.76	1,253,827.52	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	33.46	451,877.30	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	85.19	872,771.55	
	THOMSON REUTERS CORP	13,293	137.97	1,834,035.21	
	AIR CANADA	13,805	16.81	232,062.05	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	47,367	146.06	6,918,424.02	
	CP RAILWAY LIMITED	73,737	93.55	6,898,096.35	
	TFI INTERNATIONAL INC	5,837	110.30	643,821.10	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	72.88	1,696,792.16	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	86.15	264,480.50	

GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	36.38	621,334.02	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	67.44	1,556,043.12	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.15	427,880.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	36.21	1,282,630.62	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	170.13	767,796.69	
DOLLARAMA INC	22,000	78.29	1,722,380.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	52.85	3,565,630.95	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	40.43	616,678.79	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	119.11	1,538,067.43	
METRO INC	18,840	71.16	1,340,654.40	
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	154.41	806,946.66	
SAPUTO INC	20,898	29.76	621,924.48	
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	11.36	236,288.00	
BANK MONTREAL	51,389	126.31	6,490,944.59	
BANK NOVA SCOTIA	96,500	75.65	7,300,225.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,829	63.54	4,564,014.66	
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	87.67	2,392,426.63	
ROYAL BANK OF CANADA	112,726	127.56	14,379,328.56	
TORONTO-DOMINION BANK	145,047	83.22	12,070,811.34	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	110,505	58.91	6,509,849.55	
IGM FINANCIAL INC	7,685	35.37	271,818.45	
ONEX CORP	6,603	64.49	425,827.47	
TMX GROUP LTD	4,685	130.16	609,799.60	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	707.91	1,509,972.03	
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	31.73	754,793.24	
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	64.17	648,052.83	
INTACT FINANCIAL CORP	13,312	188.23	2,505,717.76	
MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	22.76	3,522,747.28	
POWER CORP OF CANADA	43,577	33.84	1,474,645.68	
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	58.92	2,692,761.84	
FIRSTSERVICE CORP	2,690	166.42	447,669.80	
BLACKBERRY LIMITED	39,400	7.69	302,986.00	
CGI INC - CL A	16,178	106.32	1,720,044.96	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	1,993.18	3,197,060.72	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	27.44	227,642.24	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	44.06	189,502.06	
OPEN TEXT CORP	20,463	51.20	1,047,705.60	
SHOPIFY INC - CLASS A	92,560	46.08	4,265,164.80	
BCE INC	6,203	63.53	394,076.59	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,167	61.54	1,610,317.18	
TELUS CORP	32,908	28.79	947,421.32	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	17.48	905,778.64	

	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	27.44	669,398.80	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	47.05	531,429.75	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	38.54	397,886.96	
	EMERA INC	23,223	60.16	1,397,095.68	
	FORTIS INC	36,823	59.69	2,197,964.87	
	HYDRO ONE LTD	23,269	34.05	792,309.45	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	39.53	705,768.62	
カナダドル 小計		3,276,052		182,351,304.90 (19,210,709,971)	
ユーロ	ENI	197,669	11.22	2,219,032.19	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	10.24	406,337.19	
	NESTE OIL OYJ	32,126	44.20	1,419,969.20	
	OMV AG	12,549	41.27	517,897.23	
	REPSOL SA	111,112	12.98	1,442,233.76	
	TENARIS SA	40,648	12.68	515,416.64	
	TOTALENERGIES SE	197,385	49.27	9,725,158.95	
	AIR LIQUIDE	41,637	128.46	5,348,689.02	
	AKZO NOBEL	15,301	63.38	969,777.38	
	ARCELORMITTAL	48,641	21.86	1,063,292.26	
	ARKEMA	4,369	93.58	408,851.02	
	BASF SE	73,837	42.91	3,168,714.85	
	COVESTRO AG	14,454	33.44	483,341.76	
	CRH PLC	59,653	34.41	2,052,957.99	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	20.42	327,475.54	
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	47.33	617,230.53	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	144.00	1,973,808.00	
	OCI NV	12,000	29.56	354,720.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	32.88	641,291.52	
	SOLVAY SA	5,356	80.68	432,122.08	
	STORA ENSO OYJ R	42,169	15.50	653,619.50	
	SYMRISE AG	9,776	107.95	1,055,319.20	
	UMICORE	17,605	33.80	595,049.00	
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	29.63	1,254,060.12	
	VOESTALPINE AG	7,152	21.16	151,336.32	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	21,143	21.69	458,591.67	
	ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	21,143	1.42	30,171.06	
	AIRBUS SE	46,955	96.04	4,509,558.20	
	ALSTOM	24,388	24.32	593,116.16	
	BOUYGUES ORD	16,606	28.58	474,599.48	
	BRENNTAG SE	12,514	62.68	784,377.52	
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	11.45	928,152.83	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	25.30	844,883.34	

DASSAULT AVIATION SA	2,130	146.30	311,619.00	
EIFFAGE	5,924	88.12	522,022.88	
FERROVIAL SA	34,303	26.00	891,878.00	
GEA GROUP AG	13,382	33.69	450,839.58	
IMCD NV	4,641	136.85	635,120.85	
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	58.76	728,506.48	
KION GROUP AG	5,887	43.04	253,376.48	
KNORR-BREMSE AG	5,022	56.78	285,149.16	
KONE OYJ-B	26,311	47.18	1,241,352.98	
LEGRAND SA	21,768	72.78	1,584,275.04	
MTU AERO ENGINES AG	3,962	175.50	695,331.00	
PRYSMIAN SPA	21,155	27.19	575,204.45	
RATIONAL AG	483	619.00	298,977.00	
RHEINMETALL AG	3,660	195.00	713,700.00	
SAFRAN SA	26,190	99.42	2,603,809.80	
SAINT-GOBAIN	40,093	42.98	1,723,397.60	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,053	117.24	5,047,533.72	
SIEMENS	61,200	99.84	6,110,208.00	
SIEMENS ENERGY AG	36,841	14.84	546,720.44	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	17.92	402,035.20	
THALES SA	8,524	119.90	1,022,027.60	
VINCI S.A.	42,507	88.18	3,748,267.26	
WARTSILA OYJ	41,917	7.91	331,898.80	
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.52	614,789.96	
RANDSTAD NV	10,558	48.62	513,329.96	
TELEPERFORMANCE	4,734	310.00	1,467,540.00	
WOLTERS KLUWER	20,839	95.88	1,998,043.32	
ADP	2,382	122.55	291,914.10	
AENA SME SA	5,508	122.00	671,976.00	
ATLANTIA SPA	35,937	22.34	802,832.58	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	5.80	263,034.74	
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	36.35	2,861,647.47	
GETLINK	35,220	17.89	630,085.80	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	76.04	1,985,176.28	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	70.55	352,115.05	
CONTINENTAL AG	8,168	67.80	553,790.40	
FERRARI NV	10,170	190.70	1,939,419.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	64,434	55.87	3,599,927.58	
MICHELIN	55,356	27.05	1,497,656.58	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	67.74	795,606.30	
RENAULT SA	17,362	24.62	427,452.44	
STELLANTIS NV	175,794	12.45	2,190,041.65	

VALEO SA	16,596	18.88	313,332.48	
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,282	134.46	1,920,357.72	
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	188.70	469,108.20	
ADIDAS AG	13,972	168.46	2,353,723.12	
ESSILORLUXOTTICA	22,910	143.65	3,291,021.50	
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,070.00	2,716,730.00	
KERING	5,855	501.00	2,933,355.00	
LVMH	22,101	606.90	13,413,096.90	
MONCLER SPA	14,361	41.48	595,694.28	
PUMA SE	9,220	65.98	608,335.60	
SEB SA	2,282	95.50	217,931.00	
ACCOR	14,436	27.21	392,803.56	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	96.22	1,255,478.56	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	31.50	255,402.00	
SODEXO	6,027	73.54	443,225.58	
BOLLORE SE	83,646	4.60	385,440.76	
PUBLICIS GROUPE	17,077	44.25	755,657.25	
SCOUT24 SE	7,492	54.88	411,160.96	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	41.94	296,557.74	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	20.94	1,282,734.63	
VIVENDI SE	61,243	9.71	595,159.47	
D'IETEREN GROUP	2,217	146.20	324,125.40	
DELIVERY HERO SE	13,414	38.82	520,731.48	
INDITEX	87,326	23.33	2,037,315.58	
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	15.90	247,625.94	
PROSUS	66,706	67.60	4,509,325.60	
ZALANDO SE	17,664	27.12	479,047.68	
CARREFOUR	52,544	17.17	902,180.48	
HELLOFRESH SE	13,805	34.04	469,922.20	
JERONIMO MARTINS	24,901	21.06	524,415.06	
KESKO OYJ-B SHS	20,083	23.33	468,536.39	
KONINKLIJKE AHOLD NV	79,170	26.39	2,089,296.30	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,711	54.63	3,753,681.93	
DANONE (GROUPE)	51,543	53.59	2,762,189.37	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	10.30	505,738.48	
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	73.40	679,023.40	
HEINEKEN NV	20,157	93.02	1,875,004.14	
JDE PEET'S BV	7,000	27.00	189,000.00	
KERRY GROUP PLC-A	13,050	96.68	1,261,674.00	
PERNOD-RICARD	16,694	177.85	2,969,027.90	
REMY COINTREAU	1,382	178.00	245,996.00	
BEIERSDORF AG	7,430	98.94	735,124.20	

HENKEL AG & CO KGAA	8,780	60.75	533,385.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	61.88	893,485.32	
LOREAL	19,188	330.45	6,340,674.60	
AMPLIFON SPA	11,650	31.15	362,897.50	
BIOMERIEUX	3,044	104.70	318,706.80	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	127.35	436,810.50	
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	135.80	281,106.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	47.60	808,486.00	
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	28.91	973,948.99	
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	21.21	1,522,282.32	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	379.20	691,660.80	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	49.23	1,061,743.41	
ARGENX SE	3,976	348.40	1,385,238.40	
BAYER	78,757	57.83	4,554,517.31	
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	77.68	793,889.60	
GRIFOLS SA	27,685	16.90	467,876.50	
IPSEN	3,532	93.15	329,005.80	
MERCK KGAA	10,555	175.10	1,848,180.50	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	44.01	433,674.54	
QIAGEN N.V.	17,038	47.43	808,112.34	
RECORDATI SPA	9,859	43.52	429,063.68	
SANOFI	90,542	99.33	8,993,536.86	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,939	336.10	651,697.90	
UCB (GROUPE)	9,389	85.94	806,890.66	
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.61	423,561.81	
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	4.39	2,351,805.80	
BANCO SANTANDER SA	1,393,640	2.61	3,641,581.32	
BNP PARIBAS	86,730	45.46	3,942,745.80	
CAIXABANK	330,447	3.00	991,671.44	
COMMERZBANK AG	81,889	6.40	524,580.93	
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	8.74	869,318.67	
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	24.50	585,672.50	
FINECOBANK SPA	53,120	12.15	645,673.60	
ING GROEP NV-CVA	301,618	9.42	2,842,146.41	
INTESA SANPAOLO	1,322,943	1.76	2,331,819.33	
KBC GROEP NV	18,608	52.92	984,735.36	
MEDIOBANCA	53,990	8.42	455,027.72	
SOCIETE GENERALE	63,329	20.82	1,318,826.42	
UNICREDIT SPA	168,352	9.49	1,597,997.18	
AMUNDI SA	4,626	51.50	238,239.00	
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	8.20	1,317,026.60	
DEUTSCHE BOERSE	14,999	159.95	2,399,090.05	

EURAZEO SA	3,357	62.10	208,469.70	
EURONEXT NV	6,480	76.62	496,497.60	
EXOR NV	7,825	62.76	491,097.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	82.28	700,614.20	
SOFINA	1,238	212.80	263,446.40	
WENDEL	2,023	82.85	167,605.55	
AEGON	148,741	4.16	619,655.00	
AGEAS	11,086	42.68	473,150.48	
ALLIANZ SE-REG	32,696	180.28	5,894,434.88	
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	15.37	1,316,240.69	
AXA SA	154,335	21.60	3,334,407.67	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	139.00	602,287.00	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,795	224.20	2,420,239.00	
NN GROUP NV	22,611	44.47	1,005,511.17	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	8.68	399,952.08	
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	42.44	1,640,518.20	
AROUNDTOWN SA	64,068	3.04	195,151.12	
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	79.34	418,518.50	
VONOVIA SE	59,080	28.46	1,681,416.80	
ADYEN NV	1,746	1,469.60	2,565,921.60	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	53.52	1,904,455.68	
BECHTLE AG	7,659	40.05	306,742.95	
CAPGEMINI SA	12,715	167.50	2,129,762.50	
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	37.26	1,966,098.42	
EDENRED	18,664	45.24	844,359.36	
NEMETSCHEK SE	5,455	61.06	333,082.30	
NEXI SPA	48,458	8.28	401,232.24	
SAP SE	83,516	89.60	7,483,033.60	
WORLDLINE SA	20,332	35.19	715,483.08	
NOKIA OYJ	427,600	4.60	1,968,029.00	
CELLNEX TELECOM SA	41,435	38.60	1,599,391.00	
DEUTSCHE TELEKOM	258,113	19.21	4,959,899.40	
ELISA A	10,227	54.32	555,530.64	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.98	303,142.50	
KPN (KON.)	282,927	3.38	957,142.04	
ORANGE	153,815	10.59	1,629,823.74	
PROXIMUS	13,141	14.39	189,098.99	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.25	220,725.71	
TELEFONICA	431,420	4.72	2,036,302.40	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.86	282,324.90	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	27.60	262,558.80	
ACCIONA SA	2,181	189.80	413,953.80	

	E.ON SE	170,377	8.18	1,394,365.36	
	EDP RENOVAVEIS SA	21,466	24.25	520,550.50	
	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	9.56	377,820.76	
	ELIA GROUP SA/NV	3,125	142.80	446,250.00	
	ENAGAS	21,663	19.65	425,786.26	
	ENDESA	25,972	18.07	469,443.90	
	ENEL	650,125	5.25	3,414,456.50	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.63	1,047,268.16	
	ENGIE	141,564	10.83	1,533,704.37	
	FORTUM OYJ	32,550	13.02	423,801.00	
	IBERDROLA SA	464,738	9.91	4,606,483.05	
	IBERDROLA SA-RTS	464,738	0.27	128,732.42	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	28.05	280,780.50	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	18.12	556,038.75	
	RWE STAMM	49,680	35.82	1,779,537.60	
	SNAM SPA	147,559	4.99	737,057.20	
	TERNA SPA	102,810	7.36	756,887.22	
	UNIPER SE	7,335	10.92	80,098.20	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	23.37	1,192,500.99	
	VERBUND AG	6,430	102.60	659,718.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,483	219.45	764,344.35	
	ASML HOLDING NV	32,248	446.15	14,387,445.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES	101,861	23.25	2,368,268.25	
	STMICROELECTRONICS	55,076	30.83	1,697,993.08	
ユーロ 小計		15,217,090		322,651,100.46 (44,716,216,012)	
イギリスポンド	BP PLC	1,555,608	3.86	6,013,202.72	
	SHELL PLC-NEW	605,870	20.43	12,380,953.45	
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	28.24	2,885,396.22	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	11.13	399,077.28	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	68.94	753,100.56	
	GLENCORE PLC	767,331	4.31	3,309,882.26	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	19.25	324,408.24	
	MONDI PLC	36,710	14.80	543,308.00	
	RIO TINTO PLC REG	89,551	48.35	4,329,790.85	
	ASHTEAD GROUP PLC	34,104	38.28	1,305,501.12	
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	8.09	2,106,322.19	
	BUNZL PLC	24,880	28.57	710,821.60	
	DCC PLC	6,622	52.66	348,714.52	
	FERGUSON PLC	17,761	92.80	1,648,220.80	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.55	498,212.56	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.87	554,067.51	

SMITHS GROUP PLC	26,476	14.21	376,223.96	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	107.25	591,376.50	
EXPERIAN PLC	74,115	26.03	1,929,213.45	
INTERTEK GROUP PLC	13,890	42.55	591,019.50	
RELX PLC	154,242	22.42	3,458,105.64	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	4.97	698,185.60	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.56	334,167.13	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	38.25	294,066.00	
BURBERRY GROUP PLC	29,776	16.39	488,177.52	
PERSIMMON PLC	25,686	17.76	456,311.79	
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.12	298,305.46	
COMPASS GROUP PLC	142,427	17.60	2,506,715.20	
ENTAIN PLC	49,630	10.97	544,441.10	
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	45.13	668,420.43	
WHITBREAD PLC	17,434	25.44	443,520.96	
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.92	428,975.04	
INFORMA PLC	110,598	5.43	600,768.33	
PEARSON	55,305	7.76	429,498.63	
WPP PLC	95,821	8.00	767,142.92	
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.24	258,427.83	
KINGFISHER PLC	153,717	2.50	385,368.51	
NEXT PLC	11,468	62.82	720,419.76	
OCADO GROUP PLC	35,862	8.67	310,923.54	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.16	321,738.61	
TESCO PLC	601,050	2.61	1,573,548.90	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	15.90	409,394.70	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	173,494	33.83	5,869,302.02	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	18.46	331,631.40	
DIAGEO	184,500	35.37	6,526,687.50	
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	18.15	1,381,232.40	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,022	62.46	3,561,594.12	
UNILEVER PLC	201,915	38.36	7,745,459.40	
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.35	778,896.22	
ASTRAZENECA	123,390	110.44	13,627,191.60	
GSK PLC	405,046	17.54	7,107,747.20	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	16.97	279,224.38	
BARCLAYS	1,339,545	1.51	2,035,572.58	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,613,344	5.25	8,482,962.75	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,667,831	0.42	2,391,824.68	
NATWEST GROUP PLC	443,701	2.18	970,817.78	
STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.79	1,230,912.12	
3I GROUP PLC	74,757	11.58	865,686.06	

	ABRDN PLC	153,430	1.63	251,164.91	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.14	269,461.53	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	76.12	2,001,727.64	
	M&G PLC	229,107	1.94	445,154.90	
	SCHRODERS PLC	11,794	27.30	321,976.20	
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	11.44	468,284.96	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.35	379,554.25	
	AVIVA PLC	225,378	4.01	904,441.91	
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.44	1,125,634.23	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.96	303,965.96	
	PRUDENTIAL	210,968	10.16	2,144,489.72	
	AVEVA GROUP PLC	10,917	23.58	257,422.86	
	SAGE GROUP PLC	76,660	6.63	508,409.12	
	HALMA PLC	31,069	21.44	666,119.36	
	BT GROUP PLC	557,358	1.93	1,077,930.37	
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.28	2,832,216.71	
	NATIONAL GRID PLC	286,046	10.68	3,056,401.51	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	27.37	614,949.16	
	SSE PLC	81,663	16.93	1,382,962.90	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.13	593,415.40	
イギリスポンド 小計		22,541,258		140,787,862.70 (23,073,722,817)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.93	311,946.14	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	740.00	424,760.00	
	GIVAUDAN-REG	748	3,446.00	2,577,608.00	
	HOLCIM LTD	44,847	41.53	1,862,495.91	
	SIKA AG-BR	11,714	225.70	2,643,849.80	
	ABB LTD	127,656	26.50	3,382,884.00	
	GEBERIT AG-REG	2,964	478.00	1,416,792.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	180.40	369,459.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	183.70	568,000.40	
	VAT GROUP AG	1,956	227.80	445,576.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	33.50	350,075.00	
	SGS SA	506	2,232.00	1,129,392.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	236.50	1,082,460.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,341	102.25	4,227,117.25	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	229.50	569,848.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	42.62	167,837.56	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,182.00	610,960.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	101,100.00	808,800.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,960.00	816,720.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	224,341	114.64	25,718,452.24	

	ALCON INC	39,333	70.10	2,757,243.30	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,007	323.60	1,296,665.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	120.35	1,027,789.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	70.10	129,685.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	566.00	3,336,570.00	
	NOVARTIS	174,768	82.76	14,463,799.68	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	379.20	839,928.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	56,019	321.90	18,032,516.10	
	VIFOR PHARMA AG/NEW	3,360	169.85	570,696.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	5.54	1,182,346.90	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	44.19	835,058.43	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	900.60	1,650,799.80	
	UBS GROUP AG	281,888	15.64	4,410,137.76	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	157.40	499,587.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	476.50	1,152,653.50	
	SWISS RE LTD	24,445	74.00	1,808,930.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,053	422.10	5,087,571.30	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	85.80	487,258.20	
	TEMENOS AG - REG	5,150	83.30	428,995.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	53.36	783,644.96	
	SWISSCOM	2,187	533.40	1,166,545.80	
スイスフラン 小計		1,382,744		111,433,456.83 (15,541,624,224)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	22,252	326.65	7,268,615.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	10,000	421.70	4,217,000.00	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	157.75	6,923,174.25	
	ALFA LAVAL AB	27,268	266.80	7,275,102.40	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	231.40	18,085,761.20	
	ATLAS COPCO A	205,280	102.40	21,020,672.00	
	ATLAS COPCO B	127,608	91.31	11,651,886.48	
	EPIROC AB-A	53,479	169.80	9,080,734.20	
	EPIROC AB-B	28,804	150.25	4,327,801.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	81.86	3,168,964.32	
	INDUTRADE AB	22,644	205.50	4,653,342.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	222.00	3,108,444.00	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	174.10	3,128,577.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	83.96	10,314,318.08	
	SANDVIK AB	87,644	175.85	15,412,197.40	
	SKANSKA B	25,507	161.60	4,121,931.20	
	SKF AB-B	24,865	165.65	4,118,887.25	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	174.90	2,363,598.60	
	VOLVO B	121,238	169.26	20,520,743.88	

	SECURITAS B	29,533	92.96	2,745,387.68	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	77.65	3,869,998.35	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	146.52	3,116,333.88	
	EVOLUTION AB	14,096	927.90	13,079,678.40	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	82.89	4,405,354.83	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	131.40	7,257,090.60	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	105.90	13,477,893.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	274.40	13,575,665.60	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	245.60	4,370,697.60	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	232.80	3,337,188.00	
	NORDEA BANK ABP	253,851	94.95	24,103,152.45	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	106.55	13,984,154.75	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	92.48	10,240,865.28	
	SWEDBANK AB-A	72,526	133.80	9,703,978.80	
	EQT AB	23,207	224.40	5,207,650.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	244.00	2,883,592.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	240.80	2,689,254.40	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	196.90	7,664,332.50	
	INVESTOR AB-B SHS	142,777	179.94	25,691,293.38	
	KINNEVIK AB - B	18,792	158.55	2,979,471.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	442.10	3,218,488.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	50.98	2,890,566.00	
	SAGAX AB-B	12,402	207.20	2,569,694.40	
	SINCH AB	44,150	36.20	1,598,230.00	
	ERICSSON (LM) B	225,508	80.37	18,124,077.96	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	112.70	17,337,542.60	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	121.40	5,676,906.80	
	TELIA CO AB	230,643	40.37	9,311,057.91	
スウェーデンクローナ 小計		3,109,996		395,871,348.63 (5,114,657,824)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	27,755	331.90	9,211,884.50	
	EQUINOR ASA	76,370	334.75	25,564,857.50	
	NORSK HYDRO	96,800	55.02	5,325,936.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	409.70	5,120,430.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	351.20	3,036,124.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	75.75	1,448,112.75	
	MOWI ASA	31,968	234.80	7,506,086.40	
	ORKLA	69,804	81.64	5,698,798.56	
	SALMAR ASA	5,423	706.50	3,831,349.50	
	DNB BANK ASA	71,795	180.20	12,937,459.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	205.00	3,807,670.00	
	TELENOR ASA	51,193	133.65	6,841,944.45	

ノルウェークローネ 小計		489,942		90,330,653.26 (1,220,367,125)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	477.00	4,046,391.00	
	NOVOZYMES A/S	17,111	438.80	7,508,306.80	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,649.50	1,245,372.50	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	81,654	170.86	13,951,402.44	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	17,630.00	3,860,970.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	17,710.00	7,686,140.00	
	DSV A/S	15,307	1,047.50	16,034,082.50	
	PANDORA A/S	8,163	476.90	3,892,934.70	
	CARLSBERG AS-B	7,077	938.20	6,639,641.40	
	COLOPLAST-B	9,208	827.40	7,618,699.20	
	DEMANT A/S	8,512	276.10	2,350,163.20	
	GN STORE NORD A/S	9,226	253.20	2,336,023.20	
	GENMAB A/S	5,250	2,494.00	13,093,500.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	134,058	799.00	107,112,342.00	
	DANSKE BANK A/S	56,132	102.00	5,725,464.00	
	TRYG A/S	29,772	161.70	4,814,132.40	
	ORSTED A/S	15,439	804.70	12,423,763.30	
デンマーククローネ 小計		406,800		220,339,328.64 (4,102,718,299)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	33.64	693,959.56	
	SANTOS	265,406	7.06	1,873,766.36	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	24.25	310,715.25	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	146,194	30.80	4,502,775.20	
	BHP GROUP LTD	405,288	39.22	15,895,395.36	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	15.75	547,627.50	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	2.45	299,277.30	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	17.30	2,397,641.60	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	35.12	1,297,613.76	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	46.88	675,493.92	
	NEWCREST MINING LIMITED	73,939	19.76	1,461,034.64	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	7.00	711,396.00	
	ORICA LTD	38,288	15.55	595,378.40	
	RIO TINTO LTD	28,818	97.43	2,807,737.74	
	SOUTH32 LTD	341,133	3.73	1,272,426.09	
	REECE LTD	16,814	14.61	245,652.54	
	BRAMBLES LTD	108,007	11.06	1,194,557.42	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.77	450,858.07	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.44	377,400.00	
	TRANSURBAN GROUP	249,674	14.29	3,567,841.46	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	36.57	1,689,899.70	

	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	75.51	267,380.91	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	25.80	459,059.40	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.54	826,339.02	
	REA GROUP LTD	3,586	122.50	439,285.00	
	SEEK LTD	28,001	22.38	626,662.38	
	WESFARMERS LTD	91,917	44.76	4,114,204.92	
	COLES GROUP LTD	108,486	18.33	1,988,548.38	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.84	861,623.84	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	36.83	3,679,353.83	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.43	731,062.80	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	202.16	966,931.28	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	70.50	1,145,484.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	33.30	1,240,458.30	
	CSL LIMITED	38,619	287.35	11,097,169.65	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	225,511	22.70	5,119,099.70	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	136,527	92.59	12,641,034.93	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	253,530	28.11	7,126,728.30	
	WESTPAC BANKING	283,793	19.95	5,661,670.35	
	ASX LTD	14,549	85.14	1,238,701.86	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,434	170.69	5,024,089.46	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	168,725	4.36	735,641.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.30	766,203.90	
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	11.79	1,315,657.89	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	11.05	1,048,247.20	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.40	1,082,774.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	41.97	579,227.97	
	XERO LTD	11,340	87.04	987,033.60	
	TELSTRA CORP	308,467	3.86	1,190,682.62	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	5.70	863,361.90	
オーストラリアドル 小計		5,292,463		116,692,166.66 (10,893,213,757)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.36	867,530.56	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	21.41	855,971.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.93	853,471.74	
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.94	383,801.22	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.75	525,084.00	
ニュージーランドドル 小計		506,126		3,485,859.32 (293,892,799)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	53.20	11,384,587.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	88.95	9,517,650.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	18.34	3,154,480.00	
	MTR CORP	125,000	41.40	5,175,000.00	

	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	23.40	2,808,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	47.65	8,291,100.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	18.66	3,694,680.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	15.02	2,586,444.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	23.10	3,370,290.00	
	WH GROUP LTD	658,301	5.87	3,864,226.87	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	29.10	8,191,650.00	
	HANG SENG BANK	59,400	133.30	7,918,020.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	375.80	36,001,640.00	
	AIA GROUP LTD	962,400	85.15	81,948,360.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	56.10	9,228,225.60	
	ESR GROUP LTD	157,000	20.80	3,265,600.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	14.58	2,522,340.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	28.80	3,606,566.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	27.35	3,729,856.25	
	SINO LAND CO	315,400	11.38	3,589,252.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	93.90	10,141,200.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	46.30	1,875,150.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	19.08	1,835,496.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	36.70	4,367,300.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	48.75	3,290,625.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	66.30	9,116,250.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	8.55	7,734,817.35	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	49.90	5,588,800.00	
香港ドル 小計		6,142,353		257,797,606.67 (4,483,100,379)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.55	738,840.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.11	605,814.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.19	562,243.08	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.73	448,950.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.13	737,618.00	
	DBS GROUP	141,500	30.03	4,249,245.00	
	OCBC BANK	257,100	11.45	2,943,795.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	26.41	2,479,899.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.60	633,600.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.85	860,475.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.88	337,264.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.36	349,600.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	16.83	432,531.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.66	1,554,884.38	
シンガポールドル 小計		2,644,675		16,934,758.46 (1,650,969,602)	

イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	31.93	1,897,504.11	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	765.00	1,641,690.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	30.65	3,013,201.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	32.00	3,483,648.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.62	1,852,690.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	120.20	1,502,860.60	
	AZRIELI GROUP	4,323	252.70	1,092,422.10	
	NICE LTD	4,991	713.50	3,561,078.50	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	161.80	1,618,000.00	
イスラエルシェケル 小計		400,064		19,663,094.81 (773,223,675)	
合　計		87,602,876		499,448,683,690 (499,448,683,690)	

(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	964,200.38	
		LENDLEASE GROUP	64,786	615,467.00	
	オーストラリアドル 小計		147,479	1,579,667.38 (147,461,949)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,598,625.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	205,000	2,230,400.00	
	香港ドル 小計		425,500	3,829,025.00 (66,586,744)	
投資信託受益証券合計			572,979	214,048,693 (214,048,693)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,110	1,772,298.50	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	894,818.42	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,293	9,255,077.93	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	124,611	762,619.32	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,159,425.92	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	1,003,739.85	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,028,602.26	
		CROWN CASTLE INTL CORP	34,413	5,898,388.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,174	2,801,241.42	
		DUKE REALTY CORP	30,517	1,747,708.59	
		EQUINIX INC	7,120	4,631,702.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,020,538.70	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	27,140	1,936,981.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,368,498.60	

		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,881,142.12	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,186,848.30	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	905,529.35	
		INVITATION HOMES INC	46,840	1,708,254.80	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,135,976.20	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	949,318.54	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	780,061.24	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,561,586.85	
		PROLOGIS INC	58,917	7,163,128.86	
		PUBLIC STORAGE	12,441	3,929,241.03	
		REALTY INCOME CORP	47,102	3,249,095.96	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	746,030.93	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,782,694.43	
		SIMON PROPERTY GROUP	25,518	2,492,853.42	
		SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,453,844.70	
		UDR INC	24,265	1,087,314.65	
		VENTAS INC	31,565	1,602,555.05	
		VICI PROPERTIES INC	75,321	2,359,053.72	
		VORNADO REALTY TRUST	11,390	333,840.90	
		WELLTOWER INC	35,629	2,925,497.19	
		WP CAREY INC	14,258	1,164,165.70	
	アメリカドル 小計		1,025,752	77,679,675.85 (10,600,945,363)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	216,738.45	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	312,588.20	
	カナダドル 小計		20,377	529,326.65 (55,764,562)	
	ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	269,932.80	
		GECINA SA	3,139	282,039.15	
		KLEPIERRE	17,225	341,485.62	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	526,513.80	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	402,916.80	
	ユーロ 小計		48,695	1,822,888.17 (252,634,071)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	371,101.62	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	317,079.65	
		SEGRO PLC	93,383	938,499.15	
	イギリスポンド 小計		219,086	1,626,680.42 (266,596,654)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	872,214.30	
		GOODMAN GROUP	133,807	2,538,318.79	
		GPT GROUP	167,884	760,514.52	
		MIRVAC GROUP	266,683	562,701.13	

		SCENTRE GROUP	382,183	1,039,537.76	
		STOCKLAND	207,412	784,017.36	
		VICINITY CENTERS	365,149	684,654.37	
	オーストラリアドル 小計		1,617,208	7,241,958.23 (676,036,800)	
	香港ドル	LINK REIT	170,500	11,056,925.00	
	香港ドル 小計		170,500	11,056,925.00 (192,279,925)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	826,841.58	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	714,900.90	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	396,000.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	498,412.64	
	シンガポールドル 小計		1,127,756	2,436,155.12 (237,500,762)	
投資証券合計			4,229,374	12,281,758,137 (12,281,758,137)	
合計				12,495,806,830 (12,495,806,830)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　604銘柄	97.2%	—	—	72.0%
	投資証券　35銘柄	—	—	2.8%	2.1%
カナダドル	株式　86銘柄	99.7%	—	—	3.8%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式　225銘柄	99.4%	—	—	8.7%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.6%	0.0%
イギリスポンド	株式　78銘柄	98.9%	—	—	4.5%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.1%	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　47銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　17銘柄	100.0%	—	—	0.8%

オーストラリアドル	株式　50銘柄	93.0%	—	—	2.1%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.3%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	5.8%	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	94.5%	—	—	0.9%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.4%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	87.4%	—	—	0.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	12.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	132,714,085
コール・ローン	2,259,410,488
国債証券	312,597,223,127
派生商品評価勘定	15,844,299
未収入金	2,425,783,709
未収利息	1,765,961,136
前払費用	110,429,490
差入委託証拠金	678,619,777
流動資産合計	319,985,986,111
資産合計	319,985,986,111
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,842,379
前受金	8,516,393
未払金	20,190,565
未払解約金	2,848,936,237
未払利息	690
流動負債合計	2,891,486,264
負債合計	2,891,486,264

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	100,796,020,727
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	216,298,479,120
元本等合計	317,094,499,847
純資産合計	317,094,499,847
負債純資産合計	319,985,986,111

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。 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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。 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。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

	2022年 7月11日現在

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	100,796,020,727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　3.1459円 (1万口当たり純資産額)　(31,459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 7月11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 7月11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 7月11日現在
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	100,722,788,748円
期中追加設定元本額	18,470,670,614円
期中一部解約元本額	18,397,438,635円
期末元本額	100,796,020,727円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,305,952,824円

区分	2022年 7月11日現在
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	565,418,746円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,185,410,891円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	8,298,424円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	8,270,921,438円
世界経済インデックスファンド	14,142,591,099円
ＤＣマイセレクション２５	1,953,373,140円
ＤＣマイセレクション５０	1,687,252,476円
ＤＣマイセレクション７５	1,149,779,413円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,291,263,546円
ＤＣマイセレクションＳ２５	962,102,775円
ＤＣマイセレクションＳ５０	758,811,526円
ＤＣマイセレクションＳ７５	428,499,727円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	30,366,183円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	93,070,040円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	47,767,428円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	12,983,964,905円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	589,880,876円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,572,820円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,321,326円
外国債券インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	22,529,139円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	43,815,872円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	69,623,997円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	73,263,752円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	67,320,205円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,259,879,403円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	431,085,080円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,717,821,398円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	75,470,817円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	38,388,616円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	428,711,661円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	166,511,729円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	209,226,867円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	736,001,746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）	3,528,423,540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	701,050,826円
コア投資戦略ファンド（安定型）	511,218,449円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,348,562,464円
分散投資コア戦略ファンドＡ	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドＳ	556,972,964円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	563,442,835円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,147,854,869円

区分	2022年 7月11日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	568,890,046円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	251,347,548円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	112,616,562円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,287,282,482円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	198,344,875円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	15,142,997,294円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	259,984,441円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	325,268,947円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	518,189,431円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,264,365円
グローバル経済コア	849,835,096円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	16,968,143円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,718,427円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	172,558,497円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	30,451,896円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	18,806,212円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	18,856,106円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	8,057,027円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	11,092,702円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル債券インデックス（ノーロード）	159,677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）	280,067,571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）	11,018,700,482円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	331,659,204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）	292,749,576円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	350,568,859円
ＳＭＴＡＭ９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）	81,871,472円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	70,802,270円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△8,038,387,866
合計	△8,038,387,866

(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 7月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,207,528,892	－	1,216,045,285	8,516,393
合計		1,207,528,892	－	1,216,045,285	8,516,393

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2022年 7月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	797,582,891	－	796,729,251	△853,640
	アメリカドル	449,636,386	－	452,638,879	3,002,493
	カナダドル	53,780,682	－	53,843,519	62,837
	メキシコペソ	54,111	－	54,738	627
	ユーロ	218,259,498	－	214,816,515	△3,442,983
	イギリスポンド	75,852,214	－	75,375,600	△476,614
	売建	2,477,785,061	－	2,483,445,894	△5,660,833
	アメリカドル	1,295,685,794	－	1,299,796,785	△4,110,991
	カナダドル	49,860,037	－	50,036,781	△176,744
	メキシコペソ	19,129,076	－	19,219,289	△90,213
	ユーロ	877,585,216	－	878,529,890	△944,674
	イギリスポンド	124,888,809	－	124,918,863	△30,054
	ポーランドズロチ	14,385,330	－	14,443,329	△57,999
	オーストラリアドル	37,825,288	－	37,853,675	△28,387
	オフショア人民元	58,425,511	－	58,647,282	△221,771
合計		3,275,367,952	－	3,280,175,145	△6,514,473

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,560,742.20	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,492,622.47	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,848,339.85	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,786,400.80	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,708,593.76	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,115,366.21	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,391,894.58	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,488,671.90	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,520,468.75	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	918,203.13	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,761,656.27	
		T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,597,343.72	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,835,839.82	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,272,343.76	
		T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,592,226.59	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,253,750.00	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,670,644.54	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,406,562.48	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,532,399.63	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,795,097.67	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,722,070.30	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,218,179.70	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,935,937.52	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,732,929.68	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,635,625.00	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,090,781.25	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,723,625.00	
		T 0.5% 04/30/27	11,940,000.00	10,540,781.25	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,083,144.54	

		T 0.5% 06/30/27	3,100,000.00	2,724,730.46	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,077,317.98	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,529,980.45	
		T 0.625% 03/31/27	4,500,000.00	4,006,230.48	
		T 0.625% 05/15/30	12,000,000.00	9,952,500.00	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,235,000.00	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,853,148.43	
		T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,802,584.40	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,187,500.00	
		T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,730,859.40	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,457,753.88	
		T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,075,312.50	
		T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,742,070.32	
		T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,649,531.24	
		T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,737,573.43	
		T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,274,578.12	
		T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,255,735.93	
		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,323,437.52	
		T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,464,921.86	
		T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,357,289.06	
		T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,468,234.39	
		T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,855,992.18	
		T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,069,687.50	
		T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,165,000.00	
		T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,174,823.43	
		T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	4,971,984.37	
		T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,046,219.58	
		T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,633,591.78	
		T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,185,937.52	
		T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,392,058.63	
		T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,175,000.00	
		T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,508,066.43	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,464,954.08	
		T 1.25% 08/15/31	19,380,000.00	16,585,040.62	
		T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,927,089.88	
		T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,461,875.00	
		T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,571,576.18	
		T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,826,562.52	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	4,922,753.90	
		T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,387,820.36	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,452,734.37	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,918,671.88	

		T 1.375% 11/15/31	21,030,000.00	18,130,160.26	
		T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,256,718.78	
		T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,396,027.35	
		T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,585,859.36	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,779,529.68	
		T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,022,753.92	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,204,492.23	
		T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,470,000.00	
		T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,777,246.07	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,679,496.11	
		T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,144,706.64	
		T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,902,593.75	
		T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,114,550.81	
		T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,452,636.72	
		T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,628,609.36	
		T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,759,382.84	
		T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,484,237.50	
		T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,505,937.50	
		T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,337,890.61	
		T 1.75% 08/15/41	14,500,000.00	10,854,609.37	
		T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,738,437.50	
		T 1.875% 02/15/32	5,020,000.00	4,519,568.75	
		T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	6,105,218.75	
		T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,859,250.00	
		T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,785,781.24	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,941,447.68	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,844,843.78	
		T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	6,850,031.25	
		T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,163,828.16	
		T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,600,000.00	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,020,013.69	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,277,437.50	
		T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,334,468.74	
		T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,466,546.88	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,705,687.48	
		T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,895,117.20	
		T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,644,301.56	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,947,421.88	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,602,138.64	
		T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,858,507.82	
		T 2.25% 03/31/24	12,000,000.00	11,821,875.00	
		T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,263,281.25	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,895,273.42	

		T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,307,798.46	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,184,287.08	
		T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,316,646.87	
		T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,429,648.46	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,177,937.50	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,952,154.27	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,272,125.00	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,305,451.19	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,443,662.11	
		T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,286,093.75	
		T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,588,632.84	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,693,062.52	
		T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,668,015.62	
		T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,529,312.50	
		T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,280,850.00	
		T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,633,279.68	
		T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	6,755,585.92	
		T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,922,851.55	
		T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	5,056,804.71	
		T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,437,062.10	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,919,726.55	
		T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,425,578.91	
		T 2.5% 02/15/46	5,000,000.00	4,166,015.65	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,813,593.75	
		T 2.5% 05/15/46	3,450,000.00	2,873,472.67	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,521,740.22	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,608,108.19	
		T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,922,082.87	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,154,843.75	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	4,882,869.15	
		T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,475,800.79	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,720,423.46	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,982,890.64	
		T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,409,277.37	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,440,273.46	
		T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	996,835.94	
		T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,147,960.94	
		T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,555,140.62	
		T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,494,667.96	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,815,906.25	
		T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,309,532.80	
		T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,455,418.76	

		T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,681,855.48	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,969,843.76	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,143,442.95	
		T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,722,031.25	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	5,100,466.43	
		T 2.875% 05/15/52	1,800,000.00	1,669,781.25	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,790,603.91	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,417,557.01	
		T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,854,156.26	
		T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,053,828.12	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,739,052.72	
		T 2.875% 10/31/23	7,900,000.00	7,877,009.73	
		T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,238,671.87	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,007,751.58	
		T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,429,687.50	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,218,757.85	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,802,734.40	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,110,023.84	
		T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,243,864.64	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,385,380.88	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,655,578.49	
		T 2% 08/15/51	15,150,000.00	11,497,429.68	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,738,941.43	
		T 2% 11/15/41	8,200,000.00	6,406,890.66	
		T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	991,265.62	
		T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,870,000.00	
		T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,634,889.87	
		T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	3,856,992.20	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,377,687.50	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,658,671.87	
		T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,923,462.50	
		T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,292,132.83	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	797,310.93	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,422,875.00	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,020,312.50	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,078,437.50	
		T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,087,656.25	
		T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,547,875.00	
		T 3% 02/15/47	800,000.00	733,437.50	
		T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,116,597.67	
		T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,679,296.90	
		T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,496,854.69	
		T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,280,078.12	

	T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,947,181.25	
	T 3% 08/15/48	7,250,000.00	6,726,640.62	
	T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,180,312.50	
	T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,975,781.25	
	T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,551,937.50	
	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,017,703.12	
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,630,164.06	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,154,687.50	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,169,859.37	
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,212,640.62	
	T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,385,731.26	
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,272,489.84	
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	643,371.09	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,979,437.50	
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,628,184.37	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	895,429.68	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,349,132.81	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,455,492.19	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,283,175.79	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,862,695.32	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,659,230.47	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,279,113.28	
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,708,072.26	
アメリカドル 小計		1,275,160,000.00	1,171,386,952.08 (159,859,177,350)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,050,586.40	
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,280,744.00	
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,317,704.00	
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,280,112.00	
	CAN 0.5% 12/01/30	4,940,000.00	3,933,870.20	
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,250,860.00	
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	662,928.00	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,367,841.60	
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,729,739.60	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,113,236.20	
	CAN 1.5% 04/01/25	2,710,000.00	2,586,911.80	
	CAN 1.5% 05/01/24	490,000.00	474,957.00	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,276,700.00	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,422,934.00	
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,157,280.00	
	CAN 1.5% 12/01/31	4,170,000.00	3,569,603.40	
	CAN 1.75% 12/01/53	2,260,000.00	1,624,239.40	

	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	730,312.20	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,400,057.10	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,264,005.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,751,868.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	760,000.00	714,643.20	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,312,217.90	
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	831,289.20	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,518,198.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	681,993.60	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,225,452.60	
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,150,125.30	
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,410,556.60	
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,653,876.70	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,355,679.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,156,627.50	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,020,000.00	1,177,661.40	
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,169,232.00	
	CAN 5% 06/01/37	420,000.00	503,004.60	
カナダドル 小計		66,960,000.00	61,107,047.50 (6,437,627,454)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,216,985.50	
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,956,668.80	
	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,771,875.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	54,810,000.00	48,898,741.50	
	MBONO 5% 03/06/25	5,200,000.00	4,670,432.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,490,187.10	
	MBONO 7.75% 05/29/31	45,510,000.00	42,036,221.70	
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	25,007,714.90	
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	9,610,596.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	33,730,000.00	32,827,722.50	
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	25,231,953.60	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,534,139.50	
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	25,294,176.00	
	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,515,925.80	
メキシコペソ 小計		387,590,000.00	363,063,339.90 (2,421,668,783)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,210,573.10	
	BGB 0.2% 10/22/23	630,000.00	628,380.90	
	BGB 0.35% 06/22/32	1,030,000.00	880,279.20	
	BGB 0.4% 06/22/40	1,240,000.00	865,470.40	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,616,160.60	
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	298,547.20	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,673,996.80	

		BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,655,557.80	
		BGB 0.8% 06/22/28	1,860,000.00	1,799,996.40	
		BGB 0.9% 06/22/29	2,060,000.00	1,976,673.00	
		BGB 0% 10/22/27	780,000.00	729,830.40	
		BGB 0% 10/22/31	1,830,000.00	1,543,312.20	
		BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,400,685.00	
		BGB 1.4% 06/22/53	960,000.00	703,516.80	
		BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	707,024.00	
		BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	1,009,025.20	
		BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,059,656.00	
		BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	981,781.50	
		BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,274,847.20	
		BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,935,719.10	
		BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	768,768.00	
		BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	703,225.60	
		BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,223,288.80	
		BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,437,204.00	
		BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,121,546.40	
		BGB 4.25% 03/28/41	2,030,000.00	2,539,448.80	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,285,635.00	
		BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,286,982.00	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,428,740.80	
		BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	3,001,709.10	
		BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,838,252.50	
		BKO 0% 09/15/23	3,150,000.00	3,140,928.00	
		BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,873,344.80	
		BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,476,132.00	
		BTPS 0.3% 08/15/23	1,900,000.00	1,892,229.00	
		BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	562,547.80	
		BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,784,691.90	
		BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,815,817.90	
		BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,015,360.40	
		BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,529,769.60	
		BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	668,572.90	
		BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,116,575.00	
		BTPS 0.9% 04/01/31	3,830,000.00	3,187,862.20	
		BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	727,759.80	
		BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	2,060,298.00	
		BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,903,327.30	
		BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,213,495.20	
		BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,754,907.00	
		BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	984,350.00	
		BTPS 0% 01/30/24	1,630,000.00	1,604,441.60	

		BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,578,104.20	
		BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,937,060.00	
		BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,367,459.60	
		BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,459,050.00	
		BTPS 0% 11/29/23	1,750,000.00	1,726,322.50	
		BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,793,657.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,876,192.50	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,731,585.80	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,335,690.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,281,531.00	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,397,600.00	
		BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	850,887.50	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,395,202.60	
		BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,787,238.70	
		BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,835,526.00	
		BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,278,837.20	
		BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,104,801.60	
		BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	1,008,550.00	
		BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,714,707.20	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,475,774.00	
		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,703,618.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,697,584.80	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,202,912.00	
		BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	471,470.50	
		BTPS 2.15% 09/01/52	1,300,000.00	932,737.00	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,266,776.00	
		BTPS 2.25% 09/01/36	2,850,000.00	2,461,260.00	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,425,684.80	
		BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,420,868.10	
		BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	2,966,803.20	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,007,908.50	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,017,496.00	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	1,885,549.90	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	874,168.00	
		BTPS 2.8% 06/15/29	820,000.00	818,507.60	
		BTPS 2.8% 12/01/28	2,720,000.00	2,746,900.80	
		BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	1,908,324.50	
		BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,204,178.00	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,098,380.90	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,332,002.60	
		BTPS 3.25% 03/01/38	500,000.00	481,635.00	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,970,000.00	1,862,063.70	

		BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,801,945.60	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,050,421.60	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,144,536.00	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,257,908.50	
		BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	1,908,155.40	
		BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,407,342.40	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,903,560.00	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,269,571.20	
		BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,803,811.00	
		BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,942,391.40	
		BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,459,184.00	
		BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,768,822.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,558,060.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,151,173.60	
		BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,780,779.20	
		BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,984,202.80	
		BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,447,902.70	
		BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,661,523.20	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,352,580.00	
		BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,614,053.80	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,700,706.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	883,720.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,788,043.10	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,926,893.20	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,512,544.20	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,072,854.40	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,976,870.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,584,982.40	
		DBR 0.5% 08/15/27	2,930,000.00	2,869,642.00	
		DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,272,918.70	
		DBR 0% 02/15/31	3,120,000.00	2,818,264.80	
		DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	3,246,566.40	
		DBR 0% 05/15/35	2,780,000.00	2,300,589.00	
		DBR 0% 05/15/36	3,130,000.00	2,542,530.30	
		DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,215,585.00	
		DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,245,725.00	
		DBR 0% 08/15/30	3,830,000.00	3,494,913.30	
		DBR 0% 08/15/30	670,000.00	612,266.10	
		DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,911,281.10	
		DBR 0% 08/15/50	5,330,000.00	3,426,870.20	
		DBR 0% 08/15/52	1,640,000.00	1,015,865.20	
		DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,815,611.20	
		DBR 0% 11/15/28	2,500,000.00	2,346,550.00	

		DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,318,624.20	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,334,609.20	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,686,795.00	
		DBR 1% 05/15/38	800,000.00	737,360.00	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,019,540.00	
		DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,676,509.20	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	3,939,028.80	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	4,518,012.30	
		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	2,914,483.00	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,874,380.80	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	3,870,149.10	
		DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	3,009,118.50	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,108,348.00	
		DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,101,113.90	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,260,000.00	3,374,157.40	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,832,750.40	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,951,274.40	
		DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,517,276.20	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,712,437.50	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,246,344.40	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,495,514.40	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,527,839.20	
		FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,539,140.50	
		FRTR 0.5% 05/25/29	6,650,000.00	6,221,673.50	
		FRTR 0.5% 05/25/40	3,210,000.00	2,340,603.60	
		FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	435,362.40	
		FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,334,737.80	
		FRTR 0.75% 02/25/28	2,150,000.00	2,073,352.50	
		FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,063,371.30	
		FRTR 0.75% 05/25/52	3,680,000.00	2,328,998.40	
		FRTR 0.75% 05/25/53	2,560,000.00	1,581,081.60	
		FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,604,066.00	
		FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,813,770.50	
		FRTR 0% 02/25/25	2,050,000.00	2,003,649.50	
		FRTR 0% 02/25/26	4,460,000.00	4,295,916.60	
		FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,310,476.80	
		FRTR 0% 03/25/24	4,260,000.00	4,225,664.40	
		FRTR 0% 03/25/25	6,390,000.00	6,243,093.90	
		FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,730,140.80	
		FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,688,606.20	
		FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,242,901.20	
		FRTR 0% 11/25/31	5,790,000.00	4,898,455.80	

		FRTR 1.25% 05/25/34	4,390,000.00	4,003,987.30	
		FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,549,540.50	
		FRTR 1.5% 05/25/31	6,170,000.00	6,067,207.80	
		FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	2,884,206.00	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,410,703.40	
		FRTR 1.75% 06/25/39	3,320,000.00	3,088,430.00	
		FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,259,923.20	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,595,688.00	
		FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,286,072.00	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,227,756.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	7,180,000.00	7,674,558.40	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,110,000.00	5,488,344.40	
		FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,238,994.80	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,400,000.00	3,884,058.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	5,600,000.00	6,107,808.00	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,931,031.00	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	5,925,222.80	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,630,000.00	4,698,853.50	
		FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,177,556.80	
		FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,705,360.70	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	4,155,412.20	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,508,771.50	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,907,000.40	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,211,315.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	884,048.70	
		IRISH 0.2% 10/18/30	960,000.00	849,801.60	
		IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	401,953.40	
		IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	490,824.30	
		IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	362,810.00	
		IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	747,685.40	
		IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	718,564.50	
		IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,169,268.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	625,579.00	
		IRISH 1.35% 03/18/31	990,000.00	963,151.20	
		IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	640,768.00	
		IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	768,299.00	
		IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,638,802.80	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,284,620.70	
		IRISH 2% 02/18/45	1,280,000.00	1,189,324.80	
		IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,016,899.50	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,299,629.20	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,270,937.90	
		NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,451,119.60	

		NETHER 0.5% 01/15/40	1,930,000.00	1,522,017.30	
		NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,274,667.20	
		NETHER 0.5% 07/15/32	700,000.00	624,799.00	
		NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,530,687.60	
		NETHER 0.75% 07/15/28	2,080,000.00	2,018,432.00	
		NETHER 0% 01/15/24	2,230,000.00	2,216,397.00	
		NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,150,908.50	
		NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,752,544.80	
		NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,272,378.20	
		NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	715,977.60	
		NETHER 0% 01/15/52	1,610,000.00	923,946.80	
		NETHER 0% 07/15/30	1,150,000.00	1,022,591.50	
		NETHER 0% 07/15/31	1,770,000.00	1,541,882.40	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,540,000.00	1,560,004.60	
		NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,176,933.80	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,723,001.10	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,047,252.30	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	2,911,972.50	
		NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,764,981.20	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,124,664.90	
		OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,308,321.70	
		OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,985,390.80	
		OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,686,625.00	
		OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,054,537.00	
		OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	2,799,544.00	
		OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,426,080.00	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,506,391.10	
		OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,379,465.30	
		RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	458,136.00	
		RAGB 0.5% 02/20/29	2,130,000.00	1,997,918.70	
		RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,057,583.40	
		RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	233,666.40	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,169,598.10	
		RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	531,086.40	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,055,788.80	
		RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	147,968.70	
		RAGB 0.9% 02/20/32	510,000.00	465,997.20	
		RAGB 0% 02/20/30	1,690,000.00	1,495,835.90	
		RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,408,300.80	
		RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	909,158.70	
		RAGB 0% 07/15/23	1,120,000.00	1,114,545.60	
		RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,425,787.20	

		RAGB 0% 10/20/28	200,000.00	182,140.00	
		RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	443,017.40	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,082,219.40	
		RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	886,654.90	
		RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	190,142.10	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,014,245.10	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,354,392.20	
		RAGB 1.85% 05/23/49	540,000.00	492,706.80	
		RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	686,272.50	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,126,580.40	
		RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	964,061.60	
		RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	569,885.40	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,269,703.80	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,564,909.90	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,475,590.00	
		RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	337,695.60	
		RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	253,717.60	
		RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	466,430.40	
		RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	353,000.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	607,042.00	
		RFGB 0.5% 04/15/43	440,000.00	309,909.60	
		RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	838,279.80	
		RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	615,751.50	
		RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	708,244.00	
		RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	739,816.00	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	688,958.10	
		RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	566,676.90	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	414,220.80	
		RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	286,305.00	
		RFGB 0% 09/15/30	800,000.00	699,264.00	
		RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	510,451.20	
		RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	413,604.10	
		RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	473,790.80	
		RFGB 2.625% 07/04/42	680,000.00	716,114.80	
		RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	594,621.50	
		RFGB 2% 04/15/24	660,000.00	677,773.80	
		RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	908,044.90	
		SPGB 0.1% 04/30/31	3,180,000.00	2,642,325.60	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,263,550.50	
		SPGB 0.35% 07/30/23	2,020,000.00	2,013,152.20	
		SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	3,024,776.00	
		SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,181,004.80	
		SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	2,676,594.00	

		SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,877,326.00	
		SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,341,936.40	
		SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,106,855.20	
		SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,221,746.00	
		SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,590,745.60	
		SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,451,049.60	
		SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,754,871.80	
		SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,079,827.00	
		SPGB 0% 05/31/25	990,000.00	957,132.00	
		SPGB 1.2% 10/31/40	2,810,000.00	2,129,474.20	
		SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,846,870.00	
		SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,222,672.50	
		SPGB 1.4% 04/30/28	3,070,000.00	3,011,731.40	
		SPGB 1.4% 07/30/28	3,850,000.00	3,764,068.00	
		SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,611,667.20	
		SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,005,800.00	
		SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	364,999.80	
		SPGB 1.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,993,820.00	
		SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,094,347.00	
		SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,507,560.00	
		SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	672,804.00	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	2,868,672.80	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,740,000.00	2,711,257.40	
		SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	635,584.60	
		SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	1,501,537.70	
		SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,898,121.60	
		SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,408,255.60	
		SPGB 2.55% 10/31/32	950,000.00	953,800.00	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	1,736,909.50	
		SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,183,071.50	
		SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,162,402.00	
		SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,830,712.20	
		SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,657,440.80	
		SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	2,986,563.80	
		SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,819,927.00	
		SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,139,137.20	
		SPGB 4.7% 07/30/41	2,240,000.00	2,850,803.20	
		SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,551,296.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,030,000.00	2,632,301.00	
		SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	4,176,273.60	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,371,063.20	
		SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,731,613.60	

	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,434,755.20	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,319,934.00	
ユーロ 小計		784,740,000.00	777,919,327.30 (107,811,839,570)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,431,612.00	
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,201,264.00	
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,044,780.20	
	UKT 0.25% 01/31/25	1,500,000.00	1,433,460.00	
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,749,873.80	
	UKT 0.375% 10/22/26	1,910,000.00	1,786,652.20	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,104,383.60	
	UKT 0.5% 01/31/29	1,650,000.00	1,492,788.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	674,234.40	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,642,115.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	2,810,000.00	2,205,990.50	
	UKT 0.625% 10/22/50	880,000.00	532,611.20	
	UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,329,650.40	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	805,311.00	
	UKT 0.875% 07/31/33	810,000.00	692,217.90	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,568,777.00	
	UKT 1.125% 01/31/39	850,000.00	677,577.50	
	UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	323,637.60	
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	920,322.00	
	UKT 1.25% 07/31/51	1,180,000.00	850,968.80	
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,204,832.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,575,712.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,870,190.70	
	UKT 1.5% 07/31/53	420,000.00	321,178.20	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,590,240.60	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	1,462,592.40	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	1,129,891.20	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,080,157.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	1,785,878.90	
	UKT 1.75% 09/07/37	2,190,000.00	1,952,757.30	
	UKT 1% 01/31/32	1,070,000.00	950,620.10	
	UKT 1% 04/22/24	800,000.00	787,440.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,505,025.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	2,180,000.00	2,179,673.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,718,628.60	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,785,802.80	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,380,000.00	2,594,771.20	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,600,272.10	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	2,449,942.00	

	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	1,973,232.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	1,956,306.80	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,479,995.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	1,973,305.80	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,528,180.20	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,149,070.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	2,459,577.60	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,965,567.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,603,960.30	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,570,000.00	1,906,137.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,210,000.00	2,831,673.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,761,387.80	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,118,418.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,076,844.00	
	UKT 5% 03/07/25	2,300,000.00	2,481,930.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,551,037.50	
イギリスポンド 小計		95,970,000.00	95,830,454.70 (15,705,653,220)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,758,817.60	
	SGB 0.75% 05/12/28	7,800,000.00	7,475,520.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	7,170,811.20	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,512,375.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,640,000.00	9,419,918.80	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,697,712.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,524,037.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,904,805.40	
スウェーデンクローナ 小計		63,880,000.00	64,463,997.00 (832,874,841)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,340,000.00	3,786,953.80	
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,797,461.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	6,470,000.00	6,202,206.70	
	NGB 1.75% 02/17/27	5,130,000.00	4,910,795.10	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,070,000.00	5,928,326.20	
	NGB 1.75% 09/06/29	6,340,000.00	5,901,145.20	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,220,000.00	3,014,242.00	
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,808,607.80	
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,815,251.20	
ノルウェークローネ 小計		50,830,000.00	48,164,989.60 (650,709,009)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,050,000.00	3,711,312.00	
	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,489,451.00	
	DGB 0.5% 11/15/29	9,380,000.00	8,738,970.80	

	DGB 0% 11/15/24	2,870,000.00	2,812,341.70	
	DGB 0% 11/15/31	8,390,000.00	7,193,250.40	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,653,208.50	
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,641,523.70	
	DGB 4.5% 11/15/39	13,600,000.00	18,709,792.00	
デンマーククローネ 小計		62,200,000.00	62,949,850.10 (1,172,126,208)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,850,000.00	2,161,468.50	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,004,070.40	
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,865,095.20	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,779,670.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	1,610,000.00	1,055,129.60	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,525,996.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,272,106.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,650,000.00	6,443,365.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,082,287.60	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,675,440.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,848,676.60	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,405,693.90	
	POLGB 3.75% 05/25/27	100,000.00	87,060.00	
	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,317,335.50	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	572,646.00	
ポーランドズロチ 小計		53,230,000.00	44,096,040.80 (1,281,117,863)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,229,790.90	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,128,276.80	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,660,000.00	2,382,641.80	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,219,756.20	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,697,017.40	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,261,844.10	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,910,000.00	2,453,508.30	
	ACGB 1% 11/21/31	3,610,000.00	2,883,992.90	
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,929,960.80	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,396,365.20	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,090,000.00	2,887,048.80	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,383,546.60	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,397,871.70	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	950,733.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,881,499.10	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,602,680.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,348,002.30	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,576,435.20	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,181,256.00	

	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,046,628.80	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,624,422.60	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,459,920.00	
	ACGB 3% 11/21/33	1,290,000.00	1,217,514.90	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,130,000.00	2,213,368.20	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,499,720.30	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,477,876.00	
オーストラリアドル 小計		56,070,000.00	51,331,678.10 (4,791,812,150)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	699,697.50	
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	499,843.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	588,601.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	636,692.40	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	252,624.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,059,210.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	818,274.90	
	SIGB 2.375% 06/01/25	940,000.00	933,824.20	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	395,152.80	
	SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	607,944.30	
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	717,280.40	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	602,292.60	
	SIGB 2.75% 07/01/23	620,000.00	620,998.20	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	654,875.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,360,000.00	1,367,167.20	
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	674,016.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	868,628.20	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	911,521.60	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,603,546.80	
シンガポールドル 小計		15,010,000.00	14,512,190.10 (1,414,793,412)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,510,000.00	1,337,709.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,930,694.40	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,485,689.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,559,292.60	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,830,000.00	1,620,336.90	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	937,291.20	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,660,224.60	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,588,504.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,384,179.50	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,479,360.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,130,022.60	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,976,244.90	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,127,420.00	

	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	601,692.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,152,510.40	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,780,000.00	1,808,604.60	
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,068,466.40	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,302,630.40	
	MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	3,000,630.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	2,760,000.00	2,686,501.20	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,555,650.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,920,775.00	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,801,399.80	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,456,068.40	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,340,625.20	
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,367,911.70	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,688,467.20	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,047,396.70	
マレーシアリンギット 小計		53,640,000.00	53,016,297.70 (1,634,503,061)	
イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	840,000.00	826,919.60	
	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,210,000.00	1,163,387.65	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,058,898.24	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,311,463.00	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	590,000.00	521,265.00	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	1,798,899.06	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,228,964.38	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,229,764.04	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,521,687.06	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	1,984,760.83	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,705,480.25	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,202,891.64	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,347,442.66	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,875,052.06	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	3,060,000.00	3,543,106.98	
イスラエルシェケル 小計		31,840,000.00	32,319,982.45 (1,270,938,061)	
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,142,439.20	
	CGB 2.18% 06/25/24	22,500,000.00	22,443,750.00	
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,699,709.00	
	CGB 2.47% 09/02/24	18,980,000.00	19,023,843.80	
	CGB 2.48% 04/15/27	9,000,000.00	8,932,410.00	
	CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,595,852.80	
	CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,156,288.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,281,376.00	

		CGB 2.75% 06/15/29	10,000,000.00	9,937,300.00	
		CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,049,072.80	
		CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,765,218.50	
		CGB 2.85% 06/04/27	12,330,000.00	12,436,901.10	
		CGB 2.89% 11/18/31	9,510,000.00	9,521,697.30	
		CGB 2.91% 10/14/28	7,480,000.00	7,521,214.80	
		CGB 3.01% 05/13/28	10,930,000.00	11,079,303.80	
		CGB 3.02% 05/27/31	12,290,000.00	12,423,715.20	
		CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	47,543,697.60	
		CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,062,487.00	
		CGB 3.28% 12/03/27	5,410,000.00	5,579,711.70	
		CGB 3.39% 03/16/50	5,520,000.00	5,531,592.00	
		CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	7,682,216.50	
		CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,540,570.00	
		CGB 3.81% 09/14/50	7,460,000.00	8,042,924.40	
		CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	12,988,835.80	
		CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,612,118.70	
	オフショア人民元 小計		355,060,000.00	358,594,246.00 (7,312,382,145)	
合計				312,597,223,127 (312,597,223,127)	

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%	51.1%
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　349銘柄	100.0%	34.5%
イギリスポンド	国債証券　55銘柄	100.0%	5.0%
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%	0.5%
マレーシアリンギット	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　　25銘柄	100.0%	2.3%

(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 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,747,915,012
コール・ローン	1,066,458,058
国債証券	79,938,834,161
未収利息	982,251,497
前払費用	128,672,018
流動資産合計	84,864,130,746
資産合計	84,864,130,746
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	230,400
未払金	2,002,727,475
未払解約金	282,269,338
未払利息	326
流動負債合計	2,285,227,539
負債合計	2,285,227,539
純資産の部	
元本等	
元本	47,067,575,964
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	35,511,327,243
元本等合計	82,578,903,207
純資産合計	82,578,903,207
負債純資産合計	84,864,130,746

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	2022年 7月11日現在
	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。 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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	47,067,575,964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 1.7545円 (1万口当たり純資産額) (17,545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 7月11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 7月11日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	40,865,028,836円
期中追加設定元本額	11,231,204,839円
期中一部解約元本額	5,028,657,711円
期末元本額	47,067,575,964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	5,303,294,254円
世界経済インデックスファンド	12,469,652,960円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	5,153,423,674円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	11,083,708,698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）	4,011,356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）	55,145,361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）	469,847,295円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,538,525,126円
コア投資戦略ファンド（切替型）	111,862,553円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	208,027,818円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	97,277,140円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	169,797,543円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	2,932,221,728円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	340,389,586円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	424,883,080円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	676,868,978円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	9,337,069円
グローバル経済コア	741,975,483円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	33,693,326円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	5,548,851円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	30,305,617円

区分	2022年 7月11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	22,760,104円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	8,213,124円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	9,944,183円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国債券インデックス（ノーロード）	284,888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）	58,193,652円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	470,170,421円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	107,109,719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）	13,933,739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 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△5,604,911,630
合計	△5,604,911,630

(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）

通貨関連

（2022年 7月11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	184,737,000	－	184,967,400	△230,400
	マレーシアリンギット	184,737,000	－	184,967,400	△230,400
合計		184,737,000	－	184,967,400	△230,400

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	34,280,718.00	
		MBONO 10% 12/05/24	104,250,000.00	105,603,165.00	
		MBONO 5.5% 03/04/27	17,000,000.00	14,649,750.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	198,300,000.00	176,913,345.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	61,600,000.00	60,577,440.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000.00	106,910,340.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	140,600,000.00	129,868,002.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	73,860,605.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	34,600,000.00	31,370,436.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	115,100,000.00	112,021,075.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	92,999,664.00	
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	124,913,940.00	
		MBONO 8% 11/07/47	100,600,000.00	89,598,384.00	
		MBONO 8% 12/07/23	88,000,000.00	86,322,720.00	
	メキシコペソ 小計		1,317,050,000.00	1,239,889,584.00 (8,270,187,514)	
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	138,400,000.00	114,619,627.59	
		BLTN 0% 07/01/23	55,000,000.00	48,479,722.49	
		BLTN 0% 07/01/24	30,850,000.00	24,158,449.90	
		BLTN 0% 07/01/25	38,900,000.00	27,104,800.35	
		BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	29,868,133.14	
		BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000.00	37,218,665.60	
		BNTNF 10% 01/01/29	31,700,000.00	27,665,638.31	
		BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	11,727,262.71	
		BNTNF 10% 01/01/33	600,000.00	496,039.54	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,286,250.00	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,770,562.50	
	ブラジルレアル 小計		385,600,000.00	324,395,152.13 (8,420,487,161)	

チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	805,000,000.00	634,304,270.88	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,855,000,000.00	2,584,856,770.92	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,820,000,000.00	1,713,395,369.14	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,940,000,000.00	1,741,950,715.60	
	BTPCL 4% 03/01/23	1,010,000,000.00	979,209,389.47	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	1,966,497,355.68	
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	611,994,493.44	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,730,000,000.00	1,684,096,463.72	
チリペソ 小計		13,030,000,000.00	11,916,304,828.85 (1,675,289,463)	
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	64,127,865,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	15,900,000,000.00	13,888,809,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	37,100,000,000.00	26,584,747,000.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	14,900,000,000.00	9,225,186,000.00	
コロンビアペソ 小計		133,200,000,000.00	113,826,607,000.00 (3,528,624,817)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,304,350.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	5,038,280.50	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,675,913.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	8,200,000.00	7,394,842.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,800,000.00	6,788,262.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,350,000.00	7,783,369.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,450,000.00	6,632,139.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	9,150,000.00	8,561,655.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,050,000.00	6,288,793.50	
ペルーソル 小計		61,550,000.00	55,467,604.00 (1,936,995,292)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	21,093,500.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	15,235,060.00	
ウルグアイペソ 小計		42,000,000.00	36,328,560.00 (122,924,948)	
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,261,688.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	31,654,920.00	
ドミニカペソ 小計		53,400,000.00	51,916,608.00 (129,505,978)	
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	18,721,008.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	55,623,652.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	43,400,740.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	64,900,000.00	49,397,986.00	
	CZGB 0% 12/12/24	12,000,000.00	10,396,320.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	57,000,000.00	43,433,430.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	51,826,320.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	14,324,381.00	

	CZGB 1.75% 06/23/32	47,000,000.00	36,993,700.00	
	CZGB 1% 06/26/26	54,800,000.00	46,412,312.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	62,700,000.00	56,892,099.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	63,300,000.00	55,502,073.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	58,500,000.00	51,786,540.00	
	CZGB 2% 10/13/33	64,500,000.00	50,646,045.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	19,807,700.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	33,309,060.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	44,795,460.00	
	CZGB 6% 02/26/26	39,500,000.00	40,229,170.00	
チェココルナ 小計		849,400,000.00	723,497,996.00 (4,072,063,770)	
ハンガリーフォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	461,446,425.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	222,500,000.00	205,701,250.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	378,684,360.00	
	HGB 1% 11/26/25	635,000,000.00	486,689,400.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	542,000,000.00	308,435,940.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	138,764,800.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	471,718,400.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	359,527,870.00	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	263,126,760.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	540,848,840.00	
	HGB 3% 04/25/41	321,000,000.00	161,219,040.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	356,836,375.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	375,324,300.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	438,482,560.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	200,054,800.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	593,604,000.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	396,000,000.00	379,894,680.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	572,000,000.00	503,565,920.00	
ハンガリーフォリント 小計		8,892,000,000.00	6,623,925,720.00 (2,263,965,076)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	14,030,585.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	12,066,912.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	15,200,000.00	10,180,960.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	12,400,000.00	8,126,464.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	16,104,740.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	19,800,000.00	18,250,056.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	20,298,707.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	14,351,392.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	20,600,000.00	16,750,272.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	20,345,733.00	

	POLGB 3.25% 07/25/25	20,350,000.00	18,259,851.50	
	POLGB 3.75% 05/25/27	4,800,000.00	4,178,880.00	
	POLGB 4% 10/25/23	12,700,000.00	12,211,685.00	
ポーランドズロチ 小計		224,400,000.00	185,156,237.50 (5,379,325,652)	
ルーマニアレイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,213,130.00	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	1,200,000.00	1,092,384.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	3,300,000.00	2,697,321.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	12,600,000.00	10,892,700.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	6,000,000.00	4,063,500.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	8,944,800.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	10,500,000.00	8,365,140.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	6,400,000.00	4,656,704.00	
	ROMGB 4.25% 06/28/23	11,800,000.00	11,316,672.00	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,036,716.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	3,200,000.00	2,899,584.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	3,800,000.00	2,602,278.00	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,103,570.00	
	ROMGB 4% 10/25/23	13,800,000.00	13,011,330.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	7,600,000.00	6,670,672.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	4,846,860.00	
ルーマニアレイ 小計		106,100,000.00	90,413,361.00 (2,537,243,025)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	12,200,000.00	10,807,980.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,178,685.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	14,100,000.00	14,160,207.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	14,650,000.00	14,414,135.00	
	MGS 3.582% 07/15/32	3,500,000.00	3,348,205.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	25,500,000.00	25,072,365.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,882,349.50	
	MGS 3.757% 05/22/40	18,350,000.00	16,247,640.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,155,664.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	7,691,436.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,600,000.00	1,616,560.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	20,020,672.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	20,800,000.00	20,865,936.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	14,450,000.00	14,500,575.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	8,724,534.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	26,270,920.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000.00	19,864,168.50	
	MGS 4.065% 06/15/50	12,450,000.00	11,005,302.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,260,888.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	19,516,068.50	

	MGS 4.504% 04/30/29	3,200,000.00	3,286,848.00	
	MGS 4.762% 04/07/37	9,550,000.00	9,803,934.50	
マレーシアリンギット 小計		279,350,000.00	273,695,074.00 (8,438,073,870)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	88,948,830.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	116,700,000.00	113,432,400.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000.00	182,430,480.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	50,016,720.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	54,435,318.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	111,100,000.00	104,628,425.00	
	THAIGB 1% 06/17/27	176,000,000.00	165,644,160.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	113,600,000.00	113,513,664.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	123,000,000.00	124,858,530.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	90,100,000.00	75,937,181.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	93,200,000.00	95,792,824.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	61,928,154.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	122,700,000.00	122,831,289.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	130,725,852.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	99,000,000.00	101,355,210.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000.00	191,068,605.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	198,590,400.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	111,708,190.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	136,715,170.00	
タイバーツ 小計		2,233,000,000.00	2,224,561,402.00 (8,453,333,327)	
フィリピンペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	28,878,000.00	
フィリピンペソ 小計		30,000,000.00	28,878,000.00 (70,421,890)	
インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,677,875,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,584,200,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	26,000,000,000.00	24,869,520,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	36,500,000,000.00	35,735,325,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	50,300,000,000.00	50,941,325,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	34,000,000,000.00	33,360,800,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	16,103,660,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	41,000,000,000.00	38,520,730,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	59,767,500,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	26,300,000,000.00	26,979,329,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	18,909,600,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	28,300,000,000.00	27,722,114,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	33,943,220,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	19,723,640,000.00	

		INDOGB 7.5% 06/15/35	34,700,000,000.00	34,848,863,000.00	
		INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	18,542,968,000.00	
		INDOGB 7% 05/15/27	40,800,000,000.00	41,967,696,000.00	
		INDOGB 7% 09/15/30	43,000,000,000.00	42,589,350,000.00	
		INDOGB 8.125% 05/15/24	45,600,000,000.00	47,926,512,000.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/29	31,200,000,000.00	33,193,056,000.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	33,630,726,000.00	
		INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,163,398,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/24	53,600,000,000.00	56,360,400,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	46,871,000,000.00	
		INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	22,558,920,000.00	
		INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	43,261,484,000.00	
		INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	25,761,900,000.00	
		INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,970,692,000.00	
		INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,706,899,000.00	
	インドネシアルピア 小計		892,800,000,000.00	910,192,702,000.00 (8,282,753,588)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	169,400,000.00	178,618,748.00	
		SAGB 6.25% 03/31/36	54,800,000.00	35,483,548.00	
		SAGB 6.5% 02/28/41	46,100,000.00	28,292,492.00	
		SAGB 7.75% 02/28/23	32,000,000.00	32,218,880.00	
		SAGB 7% 02/28/31	64,700,000.00	50,750,680.00	
		SAGB 8.25% 03/31/32	129,000,000.00	107,691,780.00	
		SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000.00	77,083,346.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	116,000,000.00	89,872,160.00	
		SAGB 8.75% 02/28/48	143,200,000.00	110,069,248.00	
		SAGB 8.875% 02/28/35	110,000,000.00	91,811,500.00	
		SAGB 8% 01/31/30	140,700,000.00	122,047,401.00	
		SAGB 9% 01/31/40	74,300,000.00	59,848,650.00	
	南アフリカランド 小計		1,177,900,000.00	983,788,433.00 (7,968,686,307)	
	オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,426,056.00	
		CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	2,986,770.00	
		CGB 2.36% 07/02/23	8,000,000.00	8,027,680.00	
		CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,906,880.00	
		CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,024,000.00	
		CGB 2.75% 02/17/32	7,200,000.00	7,127,928.00	
		CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	11,983,920.00	
		CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,815,713.00	
		CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,559,528.00	
		CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	17,061,902.00	
		CGB 2.89% 11/18/31	5,000,000.00	5,006,150.00	
		CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,033,060.00	

		CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,299,000.00	
		CGB 3.01% 05/13/28	15,000,000.00	15,204,900.00	
		CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,592,480.00	
		CGB 3.02% 10/22/25	12,900,000.00	13,106,013.00	
		CGB 3.03% 03/11/26	17,500,000.00	17,793,300.00	
		CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,411,400.00	
		CGB 3.13% 11/21/29	15,300,000.00	15,577,389.00	
		CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,507,531.00	
		CGB 3.22% 12/06/25	5,600,000.00	5,726,728.00	
		CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,558,140.00	
		CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,588,812.00	
		CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,682,440.00	
		CGB 3.28% 12/03/27	15,200,000.00	15,676,824.00	
		CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,663,062.00	
		CGB 3.29% 10/18/23	10,000,000.00	10,154,600.00	
		CGB 3.53% 10/18/51	5,100,000.00	5,258,967.00	
		CGB 3.72% 04/12/51	7,300,000.00	7,759,900.00	
		CGB 3.81% 09/14/50	17,500,000.00	18,867,450.00	
	オフショア人民元 小計		404,600,000.00	411,388,523.00 (8,388,952,483)	
合計				79,938,834,161 (79,938,834,161)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券　14銘柄	100.0%	10.3%
ブラジルレアル	国債証券　11銘柄	100.0%	10.5%
チリペソ	国債証券　8銘柄	100.0%	2.1%
コロンビアペソ	国債証券　4銘柄	100.0%	4.4%
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　18銘柄	100.0%	5.1%
ハンガリーフォリント	国債証券　18銘柄	100.0%	2.8%
ポーランドズロチ	国債証券　13銘柄	100.0%	6.7%
ルーマニアレイ	国債証券　16銘柄	100.0%	3.2%

マレーシアリンギット	国債証券　22銘柄	100.0%	10.6%
タイバーツ	国債証券　19銘柄	100.0%	10.6%
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%	10.4%
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

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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,892,990,763
投資証券	111,921,301,500
未収入金	141,063,905
未収配当金	804,670,812
前払金	58,731,200
差入委託証拠金	279,180,000
流動資産合計	117,097,938,180
資産合計	117,097,938,180
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	58,731,200
未払金	67,938,471
未払解約金	1,016,338,174
未払利息	1,190
流動負債合計	1,143,009,035
負債合計	1,143,009,035
純資産の部	
元本等	
元本	54,153,941,017
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	61,800,988,128
元本等合計	115,954,929,145
純資産合計	115,954,929,145
負債純資産合計	117,097,938,180

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	54,153,941,017口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.1412円 (1万口当たり純資産額) (21,412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 7月11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 7月11日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月11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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	49,323,843,791円
期中追加設定元本額	11,756,960,790円
期中一部解約元本額	6,926,863,564円
期末元本額	54,153,941,017円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,705,786,562円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,245,206円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	16,744,764,057円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	25,940,928,130円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,251,789,992円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,893,665,668円
分散投資コア戦略ファンドＡ	795,726,284円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,687,481,776円
コア投資戦略ファンド（切替型）	836,132,888円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	26,554,421円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	237,536,234円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	7,652,173円
グローバル経済コア	243,816,340円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	12,294,790円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	427,010,890円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	79,651,592円
Ｍｙ　ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	228,697円
１０資産分散投資ファンド	7,002円
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	464,425,592円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	18,776,554円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	290,852,804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）	63,046,816円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	862,312,035円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－１１（適格機関投資家専用）	260,376,353円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用）	296,878,161円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△4,373,936,926
合計	△4,373,936,926

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2022年 7月11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	不動産投信指数先物取引				
	買建	4,085,127,200	－	4,026,396,000	△58,731,200
合計		4,085,127,200	－	4,026,396,000	△58,731,200

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,070	255,231,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,256	315,506,400	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	4,782	721,125,600	
	東海道リート投資法人	787	97,037,100	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,550	2,424,650,000	

森ヒルズリート投資法人	12,088	1,834,958,400	
産業ファンド投資法人	14,594	2,654,648,600	
アドバンス・レジデンス投資法人	10,278	3,761,748,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,356	1,614,642,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,411	2,175,222,000	
ＧＬＰ投資法人	33,294	5,536,792,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,782	1,606,752,000	
日本プロロジスリート投資法人	16,819	5,752,098,000	
星野リゾート・リート投資法人	1,798	1,120,154,000	
Ｏｎｅリート投資法人	1,784	477,220,000	
イオンリート投資法人	12,089	1,829,065,700	
ヒューリックリート投資法人	9,590	1,529,605,000	
日本リート投資法人	3,172	1,149,850,000	
積水ハウス・リート投資法人	31,204	2,465,116,000	
トーセイ・リート投資法人	2,148	287,402,400	
ケネディクス商業リート投資法人	4,104	1,138,039,200	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	2,518	416,225,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,329	306,496,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	33,243	5,524,986,600	
いちごホテルリート投資法人	1,703	155,654,200	
ラサールロジポート投資法人	12,584	2,151,864,000	
スターアジア不動産投資法人	10,624	626,816,000	
マリモ地方創生リート投資法人	1,204	159,168,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,049	2,129,774,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,659	113,641,500	
投資法人みらい	12,452	608,902,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,412	298,605,600	
三菱地所物流リート投資法人	2,986	1,379,532,000	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	3,981	776,693,100	
ザイマックス・リート投資法人	1,659	212,849,700	
タカラレーベン不動産投資法人	4,054	462,561,400	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	4,008	609,216,000	
日本ビルファンド投資法人	11,985	8,245,680,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,280	6,486,680,000	
日本都市ファンド投資法人	51,867	5,456,408,400	
オリックス不動産投資法人	20,483	3,684,891,700	
日本プライムリアルティ投資法人	7,024	2,763,944,000	
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	9,854	1,417,005,200	
東急リアル・エステート投資法人	6,892	1,339,115,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	7,043	742,332,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	23,142	3,256,079,400	
森トラスト総合リート投資法人	7,347	1,032,253,500	

	インヴィンシブル投資法人	45,246	1,701,249,600	
	フロンティア不動産投資法人	3,604	1,920,932,000	
	平和不動産リート投資法人	7,008	999,340,800	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,931	2,207,523,500	
	福岡リート投資法人	5,317	881,558,600	
	ケネディクス・オフィス投資法人	3,180	2,216,460,000	
	いちごオフィスリート投資法人	8,423	708,374,300	
	大和証券オフィス投資法人	2,149	1,517,194,000	
	阪急阪神リート投資法人	4,643	681,592,400	
	スターツプロシード投資法人	1,601	391,604,600	
	大和ハウスリート投資法人	15,435	4,792,567,500	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	31,493	1,974,611,100	
	大和証券リビング投資法人	13,890	1,682,079,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	9,430	1,141,973,000	
合計		600,688	111,921,301,500	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	399,299,818
コール・ローン	111,234,721
投資証券	98,555,848,725
派生商品評価勘定	240,526
未収入金	185,364,601
未収配当金	361,069,155
流動資産合計	99,613,057,546
資産合計	99,613,057,546
負債の部	
流動負債	
未払金	210,969,933
未払解約金	15,508,761
未払利息	34
流動負債合計	226,478,728

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
負債合計	226,478,728
純資産の部	
元本等	
元本	39,468,176,591
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	59,918,402,227
元本等合計	99,386,578,818
純資産合計	99,386,578,818
負債純資産合計	99,613,057,546

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	39,468,176,591口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　2.5181円 (1万口当たり純資産額)　(25,181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 7月11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 7月11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

	2022年 7月11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	「(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。 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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	41,364,083,335円
期中追加設定元本額	8,486,061,804円
期中一部解約元本額	10,381,968,548円
期末元本額	39,468,176,591円
期末元本額の内訳	
グローバル３資産バランスオープン	58,177,468円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	92,933,067円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,683,758,722円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,249,291円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	12,415,354,671円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	17,237,332,439円

区分	2022年 7月11日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	691,010,554円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,599,810,944円
分散投資コア戦略ファンドＡ	663,634,730円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,393,496,043円
コア投資戦略ファンド（切替型）	670,889,410円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	133,525,271円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	197,133,452円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,395,181円
グローバル経済コア	236,021,994円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	11,817,729円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	247,841,401円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	67,389,589円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	183,233円
１０資産分散投資ファンド	3,975円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	960,030,534円
ＦＯＦｓ用　グローバルＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	305,448,493円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	142,356,210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）	61,423,192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）	36,636,271円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	92,875,637円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	98,941,913円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	98,437,291円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	89,958,325円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	88,558,498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）	81,551,063円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△17,835,034,281
合計	△17,835,034,281

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 7月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	113,054,790	－	113,295,316	240,526
	アメリカドル	86,072,600	－	86,241,674	169,074
	オーストラリアドル	6,529,250	－	6,534,150	4,900
	香港ドル	20,452,940	－	20,519,492	66,552
合計		113,054,790	－	113,295,316	240,526

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,940	736,488.60	
		AGREE REALTY CORP	39,746	2,915,369.10	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	37,122	659,657.94	
		ALEXANDER'S INC	1,190	273,307.30	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	78,931	11,551,551.85	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	98,325.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,081	799,701.93	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	74,632	4,844,363.12	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	158,975	5,696,074.25	
		AMERICOLD REALTY TRUST	144,381	4,532,119.59	
		APARTMENT INCOME REIT CO	82,424	3,407,408.16	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	79,751	527,951.62	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,953	1,746,252.18	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,600	496,396.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	119,850.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	74,229	14,145,078.24	

		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	391,743.00	
		BOSTON PROPERTIES	76,208	6,793,943.20	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	128,576.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	864,112.60	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	161,483	3,279,719.73	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	93,466	1,988,956.48	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	110,600.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	56,319	7,475,784.06	
		CARETRUST REIT INC	52,477	998,637.31	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	13,620	350,170.20	
		CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	195,908.00	
		CENTERSPACE	7,659	607,588.47	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	275,156.00	
		CITY OFFICE REIT INC	25,050	319,638.00	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	59,787.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	447,408.81	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	61,455	1,592,299.05	
		COUSINS PROPERTIES INC	77,846	2,207,712.56	
		CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	5,000	36,150.00	
		CTO REALTY GROWTH INC	8,400	170,604.00	
		CUBESMART	118,025	5,042,028.00	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	948,192.00	
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	134,994.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	150,967	19,071,661.11	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	207,904.00	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,858	2,043,840.50	
		DUKE REALTY CORP	205,550	11,771,848.50	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	909,028.76	
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	22,037	3,434,686.82	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	568,637.18	
		EPR PROPERTIES	40,671	1,974,170.34	
		EQUINIX INC	48,360	31,459,147.20	
		EQUITY COMMONWEALTH	58,772	1,608,589.64	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	92,206	6,678,480.58	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	181,743	12,970,997.91	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	67,427	1,478,674.11	
		ESSEX PROPERTY TRUST	34,785	9,145,672.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	71,334	12,347,202.06	
		FARMLAND PARTNERS INC	17,200	244,240.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	38,253	3,707,480.76	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	70,684	3,411,209.84	

		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,515	1,217,930.40	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	172,858.48	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	125,567	5,926,762.40	
		GETTY REALTY CORP	21,985	590,956.80	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	385,066.50	
		GLADSTONE LAND CORP	15,500	363,165.00	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	373,230.00	
		GLOBAL NET LEASE INC	57,012	794,177.16	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	80,080	2,067,665.60	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	123,697	3,569,895.42	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	288,224	7,557,233.28	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,650	131,176.50	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	54,799	1,839,602.43	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	381,010	6,077,109.50	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	79,230	1,172,604.00	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	115,571	2,346,091.30	
		INDUS REALTY TRUST INC	3,840	230,630.40	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	468,635.58	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	15,495	1,776,966.60	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	35,960	943,950.00	
		INVITATION HOMES INC	326,294	11,899,942.18	
		IRON MOUNTAIN INC	154,471	7,522,737.70	
		JBG SMITH PROPERTIES	59,353	1,401,324.33	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	331,350.00	
		KILROY REALTY CORPORATION	55,124	2,916,059.60	
		KIMCO REALTY CORP	329,127	6,523,297.14	
		KITE REALTY GROUP TRUST	114,476	1,990,737.64	
		LIFE STORAGE INC	45,348	5,176,927.68	
		LTC PROPERTIES INC	20,624	791,136.64	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	155,791	1,642,037.14	
		MACERICH CO/THE	110,615	1,007,702.65	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	957,964	550,829.30	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	323,332	5,040,745.88	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	61,525	10,448,790.75	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	95,046	4,243,803.90	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	44,489	2,274,277.68	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,513,814.40	
		NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	71,590	516,163.90	
		NETSTREIT CORP	25,337	506,740.00	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	740,490.53	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	561,887.70	

		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	126,982	3,740,889.72	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	222,112.17	
		ORION OFFICE REIT INC	30,374	319,230.74	
		PARAMOUNT GROUP INC	89,726	640,643.64	
		PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	127,795	1,759,737.15	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	72,812	1,257,463.24	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	2,333	9,565.30	
		PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	60,769	2,068,576.76	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	1,979,985.40	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	868,747.96	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	24,051	431,474.94	
		POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	105,980.00	
		PRIME US REIT	295,000	196,175.00	
		PROLOGIS INC	394,520	47,965,741.60	
		PS BUSINESS PARKS INC	10,803	2,022,429.63	
		PUBLIC STORAGE	81,454	25,725,616.82	
		REALTY INCOME CORP	319,869	22,064,563.62	
		REGENCY CENTERS CORP	83,010	4,949,886.30	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	66,972	1,053,469.56	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	88,413	5,226,976.56	
		RLJ LODGING TRUST	90,877	1,019,639.94	
		RPT REALTY	43,950	431,589.00	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	28,793	2,159,475.00	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,863	1,702,118.16	
		SAFEHOLD INC	8,335	325,898.50	
		SAUL CENTERS INC	6,800	324,632.00	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	84,169	502,488.93	
		SIMON PROPERTY GROUP	174,214	17,018,965.66	
		SITE CENTERS CORP	99,504	1,327,383.36	
		SL GREEN REALTY CORP	33,508	1,542,373.24	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	71,011	2,822,687.25	
		STAG INDUSTRIAL INC	96,394	2,945,800.64	
		STORE CAPITAL CORP	133,113	3,575,415.18	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	386,151.30	
		SUN COMMUNITIES INC	65,053	10,433,200.14	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	109,586	1,065,175.92	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	53,323	789,713.63	
		TERRENO REALTY CORP	39,525	2,230,791.00	
		UDR INC	159,872	7,163,864.32	
		UMH PROPERTIES INC	25,320	466,141.20	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	361,340.86	

		URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	885,780.00	
		URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	244,713.00	
		VENTAS INC	213,026	10,815,330.02	
		VERIS RESIDENTIAL INC	42,236	545,266.76	
		VICI PROPERTIES INC	513,921	16,096,005.72	
		VORNADO REALTY TRUST	83,354	2,443,105.74	
		WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	930,995.10	
		WELLTOWER INC	241,432	19,823,981.52	
		WHITESTONE REIT	23,074	239,277.38	
		WP CAREY INC	103,303	8,434,689.95	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,382	924,109.56	
	アメリカドル 小計		14,057,737	558,196,945.06 (76,177,137,092)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	34,242	1,148,134.26	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	345,762.00	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	156,120.00	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,260	490,373.00	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	72,200.00	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,174	2,047,816.90	
		CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,202,071.50	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	429,484.32	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	453,385.50	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	69,960	843,717.60	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	267,693.40	
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	86,040.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	867,750.45	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,745	1,367,607.15	
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	72,239	914,545.74	
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	64,641.00	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	408,739.10	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	504,166.50	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	161,505.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	214,102.90	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,000	87,930.00	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	60,470	751,642.10	
		PLAZA RETAIL REIT	25,000	101,000.00	
		PRIMARIS REIT	28,309	348,766.88	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	78,168	1,577,430.24	

	SLATE GROCERY REIT	17,300	239,605.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	76,500.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	36,116	1,004,385.96	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	799,470.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	164,088.00	
カナダドル 小計		990,445	17,196,674.50 (1,811,669,658)	
ユーロ	AEDIFICA	20,787	1,979,961.75	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	80,208.00	
	ALTAREA	2,480	339,760.00	
	BEFIMMO S.C.A.	12,210	575,701.50	
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	357,000.00	
	CARMILA	25,000	367,500.00	
	COFINIMMO	16,047	1,739,494.80	
	COIMA RES SPA	11,900	118,048.00	
	COVIVIO(FP)	25,611	1,393,238.40	
	CROMWELL REIT EUR	160,000	313,600.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	21,060	450,262.80	
	GECINA SA	29,522	2,652,551.70	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	310,430.00	
	ICADE	16,740	749,952.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	124,854.05	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	146,462	891,221.27	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	310,365.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	289,380.00	
	KLEPIERRE	101,585	2,013,922.62	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	166,260.00	
	MERCIALYS	28,000	232,540.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	172,874	1,659,590.40	
	MONTEA NV	5,300	490,250.00	
	NSI NV	10,050	338,182.50	
	RETAIL ESTATES	6,400	415,360.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	61,621	3,103,233.56	
	VASTNED RETAIL	10,650	244,417.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	74,672	2,329,766.40	
	WERELDHAVE NV	22,670	337,329.60	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	433,782.00	
ユーロ 小計		1,341,171	24,808,163.85 (3,438,163,427)	
イギリスポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	260,756	203,650.43	
	AEW UK REIT PLC	68,000	76,296.00	

		ASSURA PLC	1,592,040	1,057,910.58	
		BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	435,000	486,330.00	
		BIG YELLOW GROUP PLC	90,946	1,206,853.42	
		BRITISH LAND CO PLC	499,911	2,336,084.10	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	447,878	670,025.48	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	250,190.78	
		CUSTODIAN REIT PLC	234,276	234,041.72	
		DERWENT LONDON PLC	61,172	1,665,101.84	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	268,362.00	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	129,280	776,972.80	
		HAMMERSON PLC	1,784,000	366,255.20	
		HOME REIT PLC	419,934	481,244.36	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	206,441.22	
		INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	400,606	2,744,151.10	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	530,380	1,250,636.04	
		LXI REIT PLC	1,004,008	1,469,867.71	
		NEWRIVER REIT PL	126,000	110,880.00	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	234,232.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	735,888	1,023,620.20	
		PRS REIT PLC/THE	269,000	285,678.00	
		REGIONAL REIT LTD	222,000	158,952.00	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	110,637	1,181,603.16	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	182,350.00	
		SEGRO PLC	641,133	6,443,386.65	
		SHAFTESBURY PLC	155,193	817,867.11	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	655,099	805,771.77	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	182,347.54	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	997,516	1,840,417.02	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	365,540.00	
		UNITE GROUP PLC	215,072	2,393,751.36	
		WORKSPACE GROUP PLC	70,347	387,963.70	
	イギリスポンド 小計		14,802,740	32,174,045.29 (5,273,004,282)	
	オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	197,716	535,810.36	
		ARENA REIT	171,053	790,264.86	
		BWP TRUST	262,160	1,051,261.60	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	687,659.00	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	269,606	800,729.82	
		CENTURIA OFFICE REIT	240,945	418,039.57	
		CHARTER HALL GROUP	246,135	2,808,400.35	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	334,782	1,486,432.08	

	CHARTER HALL RETAIL REIT	261,160	1,023,747.20	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	685,447.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	822,633	653,993.23	
	DEXUS	572,242	5,304,683.34	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	309,620.00	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	308,275.00	
	GOODMAN GROUP	904,315	17,154,855.55	
	GPT GROUP	1,022,142	4,630,303.26	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	593,665.60	
	HEALTHCO REIT	137,130	201,581.10	
	HOME CONSORTIUM LTD	90,500	432,590.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	782,342	1,052,249.99	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	386,662.80	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	193,766	825,443.16	
	MIRVAC GROUP	2,122,238	4,477,922.18	
	NATIONAL STORAGE REIT	549,040	1,213,378.40	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	162,044.00	
	RURAL FUNDS GROUP	191,095	489,203.20	
	SCENTRE GROUP	2,765,307	7,521,635.04	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	571,980	1,618,703.40	
	STOCKLAND	1,279,093	4,834,971.54	
	VICINITY CENTERS	2,067,663	3,876,868.12	
	WAYPOINT REIT LTD	390,099	963,544.53	
オーストラリアドル 小計		17,903,577	67,299,985.28 (6,282,453,625)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	542,461.40	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	535,300	1,108,071.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	858,490.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	949,222.66	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	249,502	673,655.40	
ニュージーランドドル 小計		2,743,464	4,131,900.46 (348,360,527)	
香港ドル	CHAMPION REIT	938,000	3,339,280.00	
	FORTUNE REIT	756,000	4,974,480.00	
	LINK REIT	1,128,800	73,202,680.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	1,804,800.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,058,870.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,315,660	3,999,606.40	
香港ドル 小計		5,451,460	89,379,716.40 (1,554,313,268)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	376,750.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,756,818	5,112,340.38	

	ASCOTT TRUST	991,877	1,130,739.78	
	CAPITALAND CHINA TRUST	557,721	630,224.73	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,711,644	5,694,452.40	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	517,328.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	178,400	117,744.00	
	EC WORLD REIT	180,000	86,400.00	
	ESR-LOGOS REIT	2,769,764	1,121,754.42	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	342,900.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	147,977.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	574,262	1,303,574.74	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	1,578,196	2,162,128.52	
	IREIT GLOBAL	405,985	247,650.85	
	KEPPEL DC REIT	709,903	1,412,706.97	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,135,512.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	1,025,950	805,370.75	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,185,273	2,133,491.40	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,048,463	2,767,942.32	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,658,685	2,919,285.60	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	496,721.16	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	195,500	954,040.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	226,287.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	659,400	385,749.00	
	SUNTEC REIT	1,175,200	1,856,816.00	
シンガポールドル 小計		23,754,185	34,085,887.52 (3,323,033,174)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	124,538,400.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	444,116,400.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	57,840,420.00	
	JR REIT XXVII	64,338	289,842,690.00	
	JR REIT XXVII-RIGHTS	12,345	382,695.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	147,511,400.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	383,419,200.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	194,134,000.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	67,868,460.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	26,380	205,500,200.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	71,289,020.00	
	SK REITS CO LTD	30,940	176,667,400.00	
韓国ウォン 小計		424,849	2,163,110,285.00 (227,775,513)	
イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	103,500	1,945,800.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	1,104,230.00	

	イスラエルシェケル 小計	218,500	3,050,030.00 (119,938,159)	
合計		81,688,128	98,555,848,725 (98,555,848,725)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券　151銘柄	100.0%	77.3%
カナダドル	投資証券　30銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券　30銘柄	100.0%	3.5%
イギリスポンド	投資証券　34銘柄	100.0%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券　31銘柄	100.0%	6.4%
ニュージーランドドル	投資証券　5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券　6銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	投資証券　25銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券　12銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券　2銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	220,642,830
コール・ローン	8,534,422,745

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
社債券	23,507,189,499
派生商品評価勘定	953,800
未収入金	387,001,626
流動資産合計	32,650,210,500
資産合計	32,650,210,500
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,552,335,069
未払利息	2,609
流動負債合計	8,552,337,678
負債合計	8,552,337,678
純資産の部	
元本等	
元本	41,303,886,285
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△17,206,013,463
元本等合計	24,097,872,822
純資産合計	24,097,872,822
負債純資産合計	32,650,210,500

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 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。 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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

	2022年 7月11日現在

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	41,303,886,285口
2．	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損　17,206,013,463円
3．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　0.5834円 (1万口当たり純資産額)　(5,834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 7月11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 7月11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 7月11日現在
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	52,438,950,106円
期中追加設定元本額	31,901,080,113円
期中一部解約元本額	43,036,143,934円
期末元本額	41,303,886,285円
期末元本額の内訳	

区分	2022年 7月11日現在
コモディティ・オープン（ＳＭＡ専用）	26,193,511,851円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,382,793,252円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,534,969,976円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,591,178,598円
ＳＭＴＡＭコモディティ・オープン	4,225,770,381円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	806,829,613円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	121,715,635円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	1,562,144,614円
ＦＯＦｓ用　グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	811,153,081円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	73,819,284円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	△3,395,059,719
合計	△3,395,059,719

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 7月11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	273,860,000	－	272,906,200	953,800
	アメリカドル	273,860,000	－	272,906,200	953,800
合計		273,860,000	－	272,906,200	953,800

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 039 07/29/22	5,000,000.00	6,105,000.00	
		CS USD COM 019 05/31/23	8,000,000.00	6,940,800.00	
		ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000.00	4,772,000.00	
		IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000.00	5,134,500.00	
		SG ISSUER 025 10/31/22	17,000,000.00	18,836,000.00	
		SG ISSUER 026 12/30/22	17,000,000.00	18,541,900.00	
		SG ISSUER 027 02/28/23	18,000,000.00	16,878,600.00	
		SG ISSUER 028 04/28/23	23,000,000.00	20,762,100.00	
		STAR HELIOS 008 10/24/22	46,000,000.00	74,280,800.00	
	アメリカドル 小計		189,000,000.00	172,251,700.00 (23,507,189,499)	
合計				23,507,189,499 (23,507,189,499)	

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	社債券　　9銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	467,117,793
コール・ローン	62,823,485
投資信託受益証券	30,800,841,961
未収入金	9,161,430
流動資産合計	31,339,944,669
資産合計	31,339,944,669
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	127,634,251
未払金	437,832,767
未払解約金	11,723,825
未払利息	19
流動負債合計	577,190,862
負債合計	577,190,862
純資産の部	
元本等	
元本	25,625,430,409
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	5,137,323,398
元本等合計	30,762,753,807
純資産合計	30,762,753,807
負債純資産合計	31,339,944,669

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。

	2022年 7月11日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	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 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	25,625,430,409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 1.2005円 (1万口当たり純資産額) (12,005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 7月11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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
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 7月11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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	28,562,552,203円

区分	2022年 7月11日現在
期中追加設定元本額	6,967,660,991円
期中一部解約元本額	9,904,782,785円
期末元本額	25,625,430,409円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,142,523,185円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,170,298,646円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,712,735,507円
分散投資コア戦略ファンドＳ	10,094,568,830円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,401,776,538円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	531,503,932円
グローバル経済コア	865,761,480円
ＳＭＴ　ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,991,595,246円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	703,991,983円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	114,323,910円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	319,203,374円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	517,708,034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）	59,439,744円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	△1,330,295,766
合計	△1,330,295,766

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 7月11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	31,581,390,978	－	31,709,025,229	△127,634,251
	アメリカドル	31,581,390,978	－	31,709,025,229	△127,634,251
合計		31,581,390,978	－	31,709,025,229	△127,634,251

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	6,820,695	225,696,797.55	
	アメリカドル 小計		6,820,695	225,696,797.55 (30,800,841,961)	
合計			6,820,695	30,800,841,961 (30,800,841,961)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

米国株式ＬＳマザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,650,504,328
社債券	20,844,027,533
派生商品評価勘定	12,381,600
流動資産合計	22,506,913,461
資産合計	22,506,913,461
負債の部	
流動負債	
未払金	1,326,154,400
未払解約金	2,724,479
未払利息	504
流動負債合計	1,328,879,383
負債合計	1,328,879,383
純資産の部	
元本等	
元本	20,206,233,087
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	971,800,991
元本等合計	21,178,034,078
純資産合計	21,178,034,078
負債純資産合計	22,506,913,461

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 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。 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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。

	2022年 7月11日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	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 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	20,206,233,087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　1.0481円 (1万口当たり純資産額)　(10,481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 7月11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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
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 7月11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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	18,944,877,100円

区分	2022年 7月11日現在
期中追加設定元本額	4,371,214,556円
期中一部解約元本額	3,109,858,569円
期末元本額	20,206,233,087円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,649,982,651円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,003,339,241円
コア投資戦略ファンド（切替型）	920,450,992円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	302,946,176円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	13,674,134,537円
米国株式ＬＳファンド（ＳＭＡ専用）	507,293,494円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	542,904,889円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	57,331,394円
ＦＯＦｓ用　米国株式ＬＳファンドＳ（適格機関投資家専用）	547,849,713円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	1,518,641,026
合計	1,518,641,026

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 7月11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	20,989,784,200	－	20,977,402,600	12,381,600
	アメリカドル	20,989,784,200	－	20,977,402,600	12,381,600
合計		20,989,784,200	－	20,977,402,600	12,381,600

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	STAR HELIOS 004 10/18/22	133,000,000.00	152,737,067.00	
	アメリカドル 小計		133,000,000.00	152,737,067.00 (20,844,027,533)	
合計				20,844,027,533 (20,844,027,533)	

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	社債券　　1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	549,446,087
社債券	22,834,580,000
流動資産合計	23,384,026,087
資産合計	23,384,026,087
負債の部	
流動負債	
未払金	100,200,000
未払解約金	94,169,999
未払利息	167
流動負債合計	194,370,166
負債合計	194,370,166
純資産の部	
元本等	
元本	20,570,158,540
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,619,497,381
元本等合計	23,189,655,921
純資産合計	23,189,655,921
負債純資産合計	23,384,026,087

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 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。 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。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		20,570,158,540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	1.1273円
	(1万口当たり純資産額)	(11,273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 7月11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、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。
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 7月11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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	18,197,417,712円
期中追加設定元本額	3,319,746,858円
期中一部解約元本額	947,006,030円
期末元本額	20,570,158,540円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,684,063,990円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,091,906,839円
コア投資戦略ファンド（切替型）	972,395,506円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	319,912,218円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	13,932,900,150円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	571,274,733円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	61,466,873円
コモディティＬＳアルファ・ファンド（ＳＭＡ専用）	357,814,572円
ＦＯＦｓ用　コモディティＬＳアルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	578,423,659円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	△141,883,000
合計	△141,883,000

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「コモディティＬＳアルファ・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
社債券	ソシエテ・ジェネラル　０％　２０２３／０６／３０	100,000,000	100,530,000	
	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　０７／１３／２３	20,030,000,000	22,734,050,000	
合計		20,130,000,000	22,834,580,000	

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。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2022年 7月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	287,383,959
社債券	8,591,715,000
流動資産合計	8,879,098,959
資産合計	8,879,098,959
負債の部	
流動負債	
未払解約金	310,035
未払利息	87
流動負債合計	310,122
負債合計	310,122
純資産の部	
元本等	
元本	10,531,261,653
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△1,652,472,816
元本等合計	8,878,788,837
純資産合計	8,878,788,837
負債純資産合計	8,879,098,959

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 7月11日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 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。 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。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 7月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	10,531,261,653口
2．	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,652,472,816円
3．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.8431円 (1万口当たり純資産額) (8,431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 7月11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、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。
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 7月11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 7月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	21,125,701,112円
期中追加設定元本額	3,941,429,828円
期中一部解約元本額	14,535,869,287円
期末元本額	10,531,261,653円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	655,491,151円
コア投資戦略ファンド（成長型）	814,318,209円
コア投資戦略ファンド（切替型）	378,472,754円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	166,145,317円

区分	2022年 7月11日現在
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	6,791,679,147円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	222,379,488円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	24,422,379円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（ＳＭＡ専用）	237,485,736円
ＦＯＦｓ用　米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	226,412,925円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,014,454,547円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月11日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	595,880,000
合計	595,880,000

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド」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
社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　１０／１８／２２	10,210,000,000	8,591,715,000	
合計		10,210,000,000	8,591,715,000	

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5期中間計算期間(2022年7月12日から2023年1月11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す。

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 （2022年 7月11日現在）	第5期中間計算期間 （2023年 1月11日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	582,479,964	1,034,720,608
投資信託受益証券	5,668,345,514	4,333,158,144
投資証券	675,030,861	882,105,379
親投資信託受益証券	8,369,881,086	9,884,376,371
未収入金	15,000,000	-
流動資産合計	15,310,737,425	16,134,360,502
資産合計	15,310,737,425	16,134,360,502
負債の部		
流動負債		
未払金	-	30,000,000
未払解約金	7,738,638	5,106,302
未払受託者報酬	3,950,981	4,386,499
未払委託者報酬	105,096,063	116,680,910
未払利息	178	1,133
その他未払費用	395,039	438,589
流動負債合計	117,180,899	156,613,433
負債合計	117,180,899	156,613,433
純資産の部		
元本等		
元本	13,098,897,602	14,013,665,598
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,094,658,924	1,964,081,471
（分配準備積立金）	1,343,608,716	1,292,153,535
元本等合計	15,193,556,526	15,977,747,069
純資産合計	15,193,556,526	15,977,747,069
負債純資産合計	15,310,737,425	16,134,360,502

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自　2021年 7月13日 至　2022年 1月12日	第5期中間計算期間 自　2022年 7月12日 至　2023年 1月11日
営業収益		
受取配当金	-	3,157,740
受取利息	1,724	1,066
有価証券売買等損益	500,959,069	△160,894,458
営業収益合計	500,960,793	△157,735,652
営業費用		
支払利息	106,029	275,782
受託者報酬	3,758,640	4,386,499
委託者報酬	99,979,746	116,680,910
その他費用	375,800	438,589
営業費用合計	104,220,215	121,781,780
営業利益又は営業損失（△）	396,740,578	△279,517,432
経常利益又は経常損失（△）	396,740,578	△279,517,432
中間純利益又は中間純損失（△）	396,740,578	△279,517,432
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（△）	19,099,508	△371,606
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,964,125,640	2,094,658,924
剰余金増加額又は欠損金減少額	383,967,614	234,033,860
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	383,967,614	234,033,860
剰余金減少額又は欠損金増加額	191,555,044	85,465,487
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	191,555,044	85,465,487
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,534,179,280	1,964,081,471

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)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、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)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。 (3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。
３.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第5期中間計算期間は2022年 7月12日から2023年 1月11日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

		第4期 (2022年 7月11日現在)		第5期中間計算期間 (2023年 1月11日現在)	
１.	計算期間の末日における受益権の総数		13,098,897,602口		14,013,665,598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	1.1599円	1口当たり純資産額	1.1402円
		(1万口当たり純資産額)	(11,599円)	(1万口当たり純資産額)	(11,402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5期中間計算期間 (2023年 1月11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4期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日	第5期中間計算期間 自 2022年 7月12日 至 2023年 1月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	10,867,635,054円	13,098,897,602円
期中追加設定元本額	3,838,843,288円	1,447,866,956円
期中一部解約元本額	1,607,580,740円	533,098,960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

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,490,152,433
株式	494,914,276,630
派生商品評価勘定	8,535,050
未収入金	2,945,000
未収配当金	867,728,995
差入委託証拠金	157,659,400
流動資産合計	498,441,297,508
資産合計	498,441,297,508
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,186,300
前受金	4,355,900
未払解約金	57,029,615
未払利息	2,728
流動負債合計	65,574,543
負債合計	65,574,543
純資産の部	
元本等	
元本	261,665,082,476
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	236,710,640,489
元本等合計	498,375,722,965
純資産合計	498,375,722,965
負債純資産合計	498,441,297,508

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11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。 先物取引

	2023年 1月11日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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）

		2023年 1月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	261,665,082,476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　1.9046円 (1万口当たり純資産額)　(19,046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

	2023年 1月11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。

	2023年 1月11日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	263,755,440,320円
期中追加設定元本額	10,115,408,767円
期中一部解約元本額	12,205,766,611円
期末元本額	261,665,082,476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）	379,795,854円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	4,083,473,385円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	14,347,857円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	11,987,915,955円
世界経済インデックスファンド	4,504,719,791円
日本株式インデックス・オープン	3,228,412,549円
ＤＣマイセレクション２５	6,169,558,303円
ＤＣマイセレクション５０	19,071,401,721円
ＤＣマイセレクション７５	19,460,015,661円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	6,252,267,881円
ＤＣマイセレクションＳ２５	3,257,075,412円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,595,952,779円
ＤＣマイセレクションＳ７５	7,477,139,542円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	8,692,075,057円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	159,942,648円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	694,091,345円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	519,347,776円

区分	2023年 1月11日現在
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,864,215,597円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,330,420,418円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,427,334円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	16,524,804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）	170,515,554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）	25,219,362円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	95,330,151円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	22,513,920円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	60,370,555円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	776,320,396円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	408,922,014円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,660,532,505円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	37,995,017円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	16,235,877円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	443,135,050円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	246,032,707円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	324,715,250円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	33,926,824円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	554,179,042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	1,994,789,157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
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	536,642,038円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	452,086,412円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,763,584,536円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	223,702,013円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,974,154円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	56,451,212円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	28,123,777,137円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	452,804,007円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	55,545,164円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	211,542,982円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	38,314,505円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	10,275,166円
グローバル経済コア	222,601,109円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	30,851,978円
Ｍｙ　ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	523,479,470円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	26,238,708円

区分	2023年 1月11日現在
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）	246,311,392円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	21,634,324円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	19,065,996円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	7,777,956円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	10,562,271円
１０資産分散投資ファンド	32,436円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	44,562,950,956円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	766,374,139円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	350,386,789円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	25,915,833円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	367,521,214円
ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用）	45,663,218,336円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	20,051,973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）	213,671,495円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,350,404,100	－	2,354,760,000	4,355,900
合計		2,350,404,100	－	2,354,760,000	4,355,900

(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はありません。

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	87,645,591
株式	9,577,210,640
投資証券	144,640,600
派生商品評価勘定	460,298

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
未収入金	34,958,432
未収配当金	13,913,316
差入委託証拠金	6,135,750
流動資産合計	9,864,964,627
資産合計	9,864,964,627
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	59,476
前受金	403,000
未払金	790,492
未払解約金	5,277
未払利息	96
流動負債合計	1,258,341
負債合計	1,258,341
純資産の部	
元本等	
元本	9,606,234,071
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	257,472,215
元本等合計	9,863,706,286
純資産合計	9,863,706,286
負債純資産合計	9,864,964,627

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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)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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
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。

	2023年 1月11日現在
3.収益及び費用の計上基準	(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。 (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）

		2023年 1月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	9,606,234,071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　1.0268円 (1万口当たり純資産額)　(10,268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

	2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	533,705,648円
期中追加設定元本額	9,186,316,360円
期中一部解約元本額	113,787,937円
期末元本額	9,606,234,071円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	255,171,736円
コア投資戦略ファンド（成長型）	552,032,281円
コア投資戦略ファンド（切替型）	251,040,255円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	7,445,484,315円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	116,243,652円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	177,935,243円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	35,123,143円
ＤＣ日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスファンド	626,904,561円
私募日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	41,719,311円
ＦＯＦｓ用　日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	104,579,574円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	67,961,000	－	68,364,000	403,000
合計		67,961,000	－	68,364,000	403,000

(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はありません。

日本債券ツイン戦略マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,643,384,210
国債証券	41,994,998,600
社債券	38,533,305,000
コール・オプション（買）	38,816,000
プット・オプション（買）	144,176,000
派生商品評価勘定	20,120,860
未収入金	23,004,000
未収利息	134,106,932
前払費用	8,120,946
差入委託証拠金	105,560,000
流動資産合計	83,645,592,548
資産合計	83,645,592,548
負債の部	
流動負債	
コール・オプション（売）	43,147,000
プット・オプション（売）	43,898,000
前受金	20,140,000
未払金	6,507,000
未払解約金	7,348,470
未払利息	2,896
流動負債合計	121,043,366
負債合計	121,043,366
純資産の部	
元本等	
元本	89,556,947,952
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△6,032,398,770
元本等合計	83,524,549,182
純資産合計	83,524,549,182
負債純資産合計	83,645,592,548

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、社債券 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。 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。

	2023年 1月11日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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、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。 (2)債券店頭オプション取引 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、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。
3.収益及び費用の計上基準	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）

		2023年 1月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	89,556,947,952口
2.	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 6,032,398,770円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9326円 (1万口当たり純資産額) (9,326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

	2023年 1月11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

	2023年 1月11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	「(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。 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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	73,628,336,848円
期中追加設定元本額	18,532,739,328円
期中一部解約元本額	2,604,128,224円
期末元本額	89,556,947,952円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,524,365,541円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,338,184,737円
国内債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	65,110,495,245円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,785,852,899円
債券コア戦略ファンド	812,767,967円
債券コア・セレクション	3,117,964,722円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	440,430,204円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	87,418,583円
日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,959,493,353円
ＦＯＦｓ用　日本債券ツイン戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,453,940,324円
私募日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	6,926,034,377円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	売建	8,464,940,000	－	8,444,800,000	20,140,000
市場取引以外の取引	債券店頭オプション取引				
	買建				
	コール	12,155,122,000	－	38,816,000	26,556,000
	プット	4,509,105,000	－	144,176,000	88,920,000
	売建				
	コール	4,509,105,000	－	43,147,000	△3,630,000
	プット	12,155,122,000	－	43,898,000	△26,298,000
合計		41,793,394,000	－	8,714,837,000	105,688,000

(注)1.時価の算定方法

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

債券店頭オプション取引の時価については、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額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。

債券店頭オプション取引の契約額等は、行使価格ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,207,447,977
コール・ローン	345,973,741
株式	498,010,047,891
投資信託受益証券	223,631,997
投資証券	11,518,704,560
派生商品評価勘定	158,338,178
未収入金	8,268,362,650
未収配当金	471,059,403
差入委託証拠金	3,397,343,546
流動資産合計	533,600,909,943
資産合計	533,600,909,943
負債の部	

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
流動負債	
派生商品評価勘定	138,273,983
前受金	70,758,395
未払解約金	12,066,808,023
未払利息	379
流動負債合計	12,275,840,780
負債合計	12,275,840,780
純資産の部	
元本等	
元本	123,723,945,724
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	397,601,123,439
元本等合計	521,325,069,163
純資産合計	521,325,069,163
負債純資産合計	533,600,909,943

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (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。 (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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。

	2023年 1月11日現在
	(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。 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。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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。 (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）

		2023年 1月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	123,723,945,724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 4.2136円 (1万口当たり純資産額) (42,136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

	2023年 1月11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。

	2023年 1月11日現在
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	126,863,910,081円
期中追加設定元本額	8,073,799,254円
期中一部解約元本額	11,213,763,611円
期末元本額	123,723,945,724円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,853,642,091円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,410,575円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	33,518,442,358円
世界経済インデックスファンド	12,158,914,108円
外国株式インデックス・オープン	904,420,632円

区分	2023年 1月11日現在
ＤＣマイセレクション２５	791,850,685円
ＤＣマイセレクション５０	3,653,000,367円
ＤＣマイセレクション７５	4,379,220,570円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	12,328,438,675円
ＤＣマイセレクションＳ２５	410,701,907円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,882,185,664円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,681,242,418円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	35,233,576円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	152,413,073円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	114,042,584円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	10,187,487,435円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,199,973,758円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,096,466円
マイセレクション７５ＶＡ１（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ＶＡ１（適格機関投資家専用）	26,188,872円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	11,147,622円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	41,036,517円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	10,417,138円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	27,941,094円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	223,078,336円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	156,852,275円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,162,239,487円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	90,086,955円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	23,089,991円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	145,605,115円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	46,741,153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）	1,036,792,901円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,173,839,222円
コア投資戦略ファンド（安定型）	491,761,850円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,181,204,042円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,580,128,367円
分散投資コア戦略ファンドＳ	8,402,108,841円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,417,777,373円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,162,029,342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）	584,267,333円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,204,966円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	152,022,092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）	10,110,829,744円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	224,145,222円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	865,447,306円

区分	2023年 1月11日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	161,370,756円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	4,553,347円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	453,608,553円
グローバル経済コア	643,313,270円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	14,712,050円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	5,768,850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）	92,249,421円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	57,339,209円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	50,866,970円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	20,639,634円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	27,959,141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）	231,398,267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）	187,296,048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）	888,530,303円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,434,209,392円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,588,823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）	82,597,070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）	74,343,691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

（2023年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	10,978,272,665	－	11,049,031,060	70,758,395
合計		10,978,272,665	－	11,049,031,060	70,758,395

(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

（2023年 1月11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	12,231,606,300	－	12,282,300,500	△50,694,200
	アメリカドル	8,991,477,000	－	9,028,414,560	△36,937,560
	カナダドル	442,777,500	－	443,599,200	△821,700
	ユーロ	1,258,388,500	－	1,265,940,370	△7,551,870
	イギリスポンド	561,487,500	－	563,403,400	△1,915,900
	スイスフラン	357,517,500	－	359,039,500	△1,522,000
	スウェーデンクローナ	139,271,000	－	139,910,100	△639,100
	デンマーククローネ	76,488,000	－	76,510,400	△22,400
	オーストラリアドル	273,201,000	－	273,963,600	△762,600
	香港ドル	101,298,000	－	101,691,000	△393,000
	シンガポールドル	29,700,300	－	29,828,370	△128,070
合計		12,231,606,300	－	12,282,300,500	△50,694,200

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	248,518,629
コール・ローン	2,456,567
株式	9,102,684,362
投資信託受益証券	5,933,210
投資証券	215,422,205

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	3,531,787
未収配当金	8,993,008
差入委託証拠金	74,444,648
流動資産合計	9,661,984,416
資産合計	9,661,984,416
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,347,577
前受金	187,363
未払解約金	1,213,578
未払利息	2
流動負債合計	4,748,520
負債合計	4,748,520
純資産の部	
元本等	
元本	8,791,584,755
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	865,651,141
元本等合計	9,657,235,896
純資産合計	9,657,235,896
負債純資産合計	9,661,984,416

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (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。 (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。 (1)先物取引

	2023年 1月11日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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。 (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。 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。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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。 (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）

		2023年 1月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	8,791,584,755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　1.0985円 (1万口当たり純資産額)　(10,985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

	2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	1,568,393,019円
期中追加設定元本額	7,240,172,041円
期中一部解約元本額	16,980,305円
期末元本額	8,791,584,755円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	174,450,525円
コア投資戦略ファンド（成長型）	414,398,493円
コア投資戦略ファンド（切替型）	186,240,235円

区分	2023年 1月11日現在
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	105,866,103円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	5,885,533,568円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	155,144,883円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	32,144,899円
ＤＣ外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスファンド	1,762,991,208円
ＦＯＦｓ用　外国株式ＥＳＧリーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	74,814,841円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	240,237,392	－	240,424,755	187,363
合計		240,237,392	－	240,424,755	187,363

(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

（2023年 1月11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	66,248,660	－	66,251,813	△3,153
	アメリカドル	48,973,200	－	48,974,976	△1,776
	カナダドル	2,956,920	－	2,956,956	△36
	ユーロ	10,666,500	－	10,667,385	△885
	オーストラリアドル	3,652,040	－	3,652,496	△456
合計		66,248,660	－	66,251,813	△3,153

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	130,953,289
コール・ローン	3,463,214,907
国債証券	290,288,334,000
派生商品評価勘定	27,881,200
未収入金	2,533,283
未収利息	1,869,661,385
前払費用	148,830,094
差入委託証拠金	450,690,852
流動資産合計	296,382,099,010
資産合計	296,382,099,010
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,421,132
前受金	13,022,443
未払金	151,442,064
未払解約金	70,084,281
未払利息	3,795
流動負債合計	247,973,715
負債合計	247,973,715
純資産の部	
元本等	
元本	98,215,424,424
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	197,918,700,871
元本等合計	296,134,125,295
純資産合計	296,134,125,295
負債純資産合計	296,382,099,010

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。 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。

	2023年 1月11日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。 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。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	98,215,424,424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 3.0151円 (1万口当たり純資産額) (30,151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

	2023年 1月11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。

	2023年 1月11日現在
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	100,796,020,727円
期中追加設定元本額	9,467,766,017円
期中一部解約元本額	12,048,362,320円
期末元本額	98,215,424,424円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,250,648,172円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	541,098,112円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,231,334,013円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	8,447,944円

区分	2023年 1月11日現在
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	8,764,731,890円
世界経済インデックスファンド	16,099,036,461円
ＤＣマイセレクション２５	1,930,572,966円
ＤＣマイセレクション５０	1,689,327,473円
ＤＣマイセレクション７５	1,177,223,935円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,327,237,347円
ＤＣマイセレクションＳ２５	983,313,331円
ＤＣマイセレクションＳ５０	782,252,468円
ＤＣマイセレクションＳ７５	458,524,125円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	25,006,728円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	93,682,837円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	48,837,312円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	13,647,091,010円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	476,344,113円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,488,997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）	20,682,067円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	37,421,122円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	58,195,344円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	68,635,332円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	61,342,231円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,088,073,769円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	403,298,504円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,632,817,272円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	60,331,726円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	36,092,292円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	399,795,263円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	149,806,551円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	195,816,503円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	696,255,518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）	3,262,410,038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	735,039,967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	276,386,697円
分散投資コア戦略ファンドＳ	590,656,608円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	614,627,208円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,346,473,976円
コア投資戦略ファンド（切替型）	439,121,979円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	253,999,567円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	109,283,715円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,380,915,293円

区分	2023年 1月11日現在
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	191,373,969円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	10,158,748,823円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	300,103,654円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	375,799,114円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	610,479,898円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,114,970円
グローバル経済コア	859,825,110円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	18,576,490円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,893,782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）	21,180,418円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	21,122,714円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	24,633,213円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	11,259,052円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	16,679,124円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル債券インデックス（ノーロード）	100,797,263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）	150,519,956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）	11,543,939,707円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	328,677,046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）	298,390,243円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	184,320,133円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,068,977,644円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	112,214,322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）	54,156,545円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	2,416,418,951	－	2,429,441,394	13,022,443
合計		2,416,418,951	－	2,429,441,394	13,022,443

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,406,404,960	－	2,407,842,585	1,437,625
	アメリカドル	1,242,634,135	－	1,238,276,520	△4,357,615
	カナダドル	102,137,134	－	102,456,120	318,986
	ユーロ	805,204,882	－	809,092,395	3,887,513
	イギリスポンド	135,279,693	－	135,142,980	△136,713
	オフショア人民元	121,149,116	－	122,874,570	1,725,454
合計		2,406,404,960	－	2,407,842,585	1,437,625

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,544,068,616
コール・ローン	723,118,479
国債証券	85,637,287,468
派生商品評価勘定	9,310,612
未収入金	37,698,603
未収利息	1,098,855,676
前払費用	58,130,538
流動資産合計	91,108,469,992
資産合計	91,108,469,992
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,186,088
未払金	3,008,143,993
未払解約金	16,701,361
未払利息	792
流動負債合計	3,031,032,234
負債合計	3,031,032,234
純資産の部	

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	48,138,531,644
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	39,938,906,114
元本等合計	88,077,437,758
純資産合計	88,077,437,758
負債純資産合計	91,108,469,992

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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。 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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	48,138,531,644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 1.8297円 (1万口当たり純資産額) (18,297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

	2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	47,067,575,964円
期中追加設定元本額	4,019,683,041円
期中一部解約元本額	2,948,727,361円
期末元本額	48,138,531,644円

区分	2023年 1月11日現在
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国債券インデックス・オープン	4,966,603,505円
世界経済インデックスファンド	14,181,630,653円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	5,340,443,722円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	11,678,947,955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）	3,979,856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）	36,032,641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）	514,074,848円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,720,473,309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）	210,353,957円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	94,254,874円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	163,853,124円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	1,942,180,440円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	391,899,196円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	489,752,257円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	794,956,340円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	10,871,070円
グローバル経済コア	750,748,603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	36,770,058円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	29,699,378円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	11,409,480円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	14,785,575円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国債券インデックス（ノーロード）	25,209,712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）	30,498,632円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	232,296,785円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	146,163,556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）	9,986,185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）

通貨関連

（2023年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,584,374,249	－	1,593,684,861	9,310,612
	ブラジルレアル	1,584,374,249	－	1,593,684,861	9,310,612
	売建	1,584,374,249	－	1,590,560,337	△6,186,088
	アメリカドル	1,584,374,249	－	1,590,560,337	△6,186,088
合計		3,168,748,498	－	3,184,245,198	3,124,524

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,542,617,843
投資証券	122,860,938,000
未収配当金	930,594,434
前払金	218,587,600
差入委託証拠金	249,194,000
流動資産合計	127,801,931,877
資産合計	127,801,931,877
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	218,587,600
未払金	444,924,736
未払解約金	422,521,742
未払利息	3,882
流動負債合計	1,086,037,960
負債合計	1,086,037,960
純資産の部	
元本等	
元本	61,352,601,615
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	65,363,292,302

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
元本等合計	126,715,893,917
純資産合計	126,715,893,917
負債純資産合計	127,801,931,877

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	61,352,601,615口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.0654円 (1万口当たり純資産額) (20,654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

	2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	54,153,941,017円
期中追加設定元本額	10,222,949,320円
期中一部解約元本額	3,024,288,722円
期末元本額	61,352,601,615円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,739,434,796円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,348,462円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	16,724,135,174円

区分	2023年 1月11日現在
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	32,038,258,449円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,403,182,278円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,164,268,574円
分散投資コア戦略ファンドＡ	795,726,284円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,687,481,776円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,021,696,978円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	25,662,797円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	243,554,016円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	8,940,087円
グローバル経済コア	246,877,714円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	13,409,812円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	607,009,296円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	119,205,899円
Ｍｙ　ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	233,442,409円
１０資産分散投資ファンド	7,002円
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	506,551,777円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,900,838円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	539,185,488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）	88,179,009円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	582,560,084円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－１１（適格機関投資家専用）	255,846,897円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用）	291,735,719円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2023年 1月11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	不動産投信指数先物取引				
	買建	4,027,843,600	－	3,809,256,000	△218,587,600
合計		4,027,843,600	－	3,809,256,000	△218,587,600

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	294,743,122
コール・ローン	221,963,491
投資証券	80,299,061,097
派生商品評価勘定	914,104
未収配当金	312,255,853
流動資産合計	81,128,937,667
資産合計	81,128,937,667
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,365
未払解約金	12,435,382
未払利息	243
流動負債合計	12,467,990
負債合計	12,467,990
純資産の部	
元本等	
元本	34,836,857,284
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	46,279,612,393
元本等合計	81,116,469,677
純資産合計	81,116,469,677
負債純資産合計	81,128,937,667

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。

	2023年 1月11日現在
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	34,836,857,284口
2．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.3285円 (1万口当たり純資産額) (23,285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

	2023年 1月11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。

	2023年 1月11日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	39,468,176,591円
期中追加設定元本額	4,046,987,275円
期中一部解約元本額	8,678,306,582円
期末元本額	34,836,857,284円
期末元本額の内訳	
グローバル３資産バランスオープン	58,177,468円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	95,811,278円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,698,926,996円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,334,802円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	12,437,622,506円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	13,231,485,087円
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,133,064円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,090,366,067円
分散投資コア戦略ファンドＡ	717,849,611円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,552,054,929円
コア投資戦略ファンド（切替型）	489,201,341円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	128,912,429円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	182,175,015円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	7,632,225円
グローバル経済コア	238,740,300円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	12,791,110円

区分	2023年 1月11日現在
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	345,064,516円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	68,408,671円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	83,797,092円
１０資産分散投資ファンド	3,975円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,102,788,680円
ＦＯＦｓ用　グローバルＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	198,161,231円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	77,945,585円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	60,705,130円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	34,902,123円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	100,614,514円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	96,331,436円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	95,834,788円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	97,458,043円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	96,415,726円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド２０２１－１１（適格機関投資家専用）	78,211,546円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	201,079,220	－	201,993,084	913,864
	アメリカドル	165,026,120	－	165,742,764	716,644
	ユーロ	21,202,950	－	21,336,135	133,185
	シンガポールドル	14,850,150	－	14,914,185	64,035
	売建	488,261,927	－	488,294,052	△32,125
	アメリカドル	348,106,800	－	348,119,424	△12,624
	カナダドル	1,675,588	－	1,675,608	△20
	ユーロ	29,155,100	－	29,157,519	△2,419
	イギリスポンド	21,243,684	－	21,246,033	△2,349
	オーストラリアドル	28,759,815	－	28,763,406	△3,591
	ニュージーランドドル	8,435,300	－	8,435,060	240
	香港ドル	26,352,585	－	26,352,585	－
	シンガポールドル	19,382,805	－	19,386,081	△3,276
	イスラエルシェケル	5,150,250	－	5,158,336	△8,086
合計		689,341,147	－	690,287,136	881,739

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	172,874,660
コール・ローン	466,959,719
社債券	20,441,553,760
流動資産合計	21,081,388,139
資産合計	21,081,388,139
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	270,400
未払金	213,667,120
未払解約金	463,656
未払利息	511
流動負債合計	214,401,687
負債合計	214,401,687
純資産の部	
元本等	
元本	37,146,352,157
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△16,279,365,705
元本等合計	20,866,986,452
純資産合計	20,866,986,452
負債純資産合計	21,081,388,139

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 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。 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。 為替予約取引

	2023年 1月11日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	37,146,352,157口
2.	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 16,279,365,705円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.5618円 (1万口当たり純資産額) (5,618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

	2023年 1月11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。

	2023年 1月11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	(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。 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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	41,303,886,285円
期中追加設定元本額	2,300,078,024円
期中一部解約元本額	6,457,612,152円
期末元本額	37,146,352,157円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（ＳＭＡ専用）	26,019,500,161円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,496,803,456円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,287,447,959円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,030,204,672円
ＳＭＴＡＭコモディティ・オープン	3,649,444,033円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	519,659,866円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	99,192,399円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	1,512,893,947円
ＦＯＦｓ用　グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	476,095,972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）	55,109,692円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	265,000,000	－	264,729,600	△270,400
	アメリカドル	265,000,000	－	264,729,600	△270,400
合計		265,000,000	－	264,729,600	△270,400

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	34,331,250
コール・ローン	57,846,213
投資信託受益証券	32,067,488,384
未収入金	150,380,394
流動資産合計	32,310,046,241
資産合計	32,310,046,241
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	339,164,777
未払金	1,922,340
未払解約金	185,120,198
未払利息	63
流動負債合計	526,207,378
負債合計	526,207,378
純資産の部	
元本等	
元本	25,343,967,809
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,439,871,054
元本等合計	31,783,838,863
純資産合計	31,783,838,863
負債純資産合計	32,310,046,241

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月11日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	25,343,967,809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 1.2541円 (1万口当たり純資産額) (12,541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

	2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	25,625,430,409円
期中追加設定元本額	3,960,042,859円
期中一部解約元本額	4,241,505,459円
期末元本額	25,343,967,809円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,477,391,331円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,714,459,383円
分散投資コア戦略ファンドA	2,163,979,134円

区分	2023年 1月11日現在
分散投資コア戦略ファンドＳ	7,604,496,827円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,673,739,703円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	531,503,932円
グローバル経済コア	876,867,434円
ＳＭＴ　ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,919,414,782円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	867,992,469円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	167,158,762円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	620,119,342円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	637,236,456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）	89,608,254円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年 1月11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	31,182,699,974	－	31,521,864,751	△339,164,777
	アメリカドル	31,182,699,974	－	31,521,864,751	△339,164,777
合計		31,182,699,974	－	31,521,864,751	△339,164,777

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

米国株式ＬＳマザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	897,115,980
社債券	18,730,943,906
派生商品評価勘定	175,593,600
未収入金	611,294,400
流動資産合計	20,414,947,886
資産合計	20,414,947,886
負債の部	

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
流動負債	
未払解約金	153,246,230
未払利息	983
流動負債合計	153,247,213
負債合計	153,247,213
純資産の部	
元本等	
元本	19,560,096,762
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	701,603,911
元本等合計	20,261,700,673
純資産合計	20,261,700,673
負債純資産合計	20,414,947,886

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 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。 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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	19,560,096,762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 1.0359円 (1万口当たり純資産額) (10,359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

	2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2023年 1月11日現在
期首	2022年 7月12日
期首元本額	20,206,233,087円
期中追加設定元本額	1,757,507,578円
期中一部解約元本額	2,403,643,903円
期末元本額	19,560,096,762円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,536,064,402円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,960,826,847円
コア投資戦略ファンド（切替型）	911,424,708円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	267,116,183円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	13,511,397,714円
米国株式ＬＳファンド（ＳＭＡ専用）	392,979,153円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	384,407,339円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	72,834,852円
ＦＯＦｓ用　米国株式ＬＳファンドＳ（適格機関投資家専用）	523,045,564円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年 1月11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	19,157,673,600	－	18,982,080,000	175,593,600
	アメリカドル	19,157,673,600	－	18,982,080,000	175,593,600
合計		19,157,673,600	－	18,982,080,000	175,593,600

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	161,078,606
社債券	24,160,121,000
未収入金	996,560,000
流動資産合計	25,317,759,606
資産合計	25,317,759,606
負債の部	
流動負債	
未払解約金	14,330,982
未払利息	176
流動負債合計	14,331,158
負債合計	14,331,158
純資産の部	
元本等	
元本	20,461,810,487
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,841,617,961
元本等合計	25,303,428,448
純資産合計	25,303,428,448
負債純資産合計	25,317,759,606

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 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。 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。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	20,461,810,487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 1.2366円 (1万口当たり純資産額) (12,366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

	2023年 1月11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。

（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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	20,570,158,540円
期中追加設定元本額	386,847,543円
期中一部解約元本額	495,195,596円
期末元本額	20,461,810,487円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,643,050,127円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,042,690,203円
コア投資戦略ファンド（切替型）	947,787,188円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	307,588,017円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	14,278,507,341円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	405,377,233円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	76,723,911円
コモディティＬＳアルファ・ファンド（ＳＭＡ専用）	237,931,814円
ＦＯＦｓ用　コモディティＬＳアルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	522,154,653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。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	79,297,163
社債券	8,324,624,000
未収入金	437,668,000
流動資産合計	8,841,589,163
資産合計	8,841,589,163
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,004,744
未払利息	86
流動負債合計	5,004,830
負債合計	5,004,830
純資産の部	
元本等	
元本	9,881,456,682
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△1,044,872,349
元本等合計	8,836,584,333
純資産合計	8,836,584,333
負債純資産合計	8,841,589,163

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月11日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 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。 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。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月11日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	9,881,456,682口
2．	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損　1,044,872,349円
3．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　0.8943円 (1万口当たり純資産額)　(8,943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

	2023年 1月11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。

（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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	10,531,261,653円
期中追加設定元本額	117,308,021円

区分	2023年 1月11日現在
期中一部解約元本額	767,112,992円
期末元本額	9,881,456,682円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	655,491,151円
コア投資戦略ファンド（成長型）	814,318,209円
コア投資戦略ファンド（切替型）	378,472,754円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	166,145,317円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	6,791,679,147円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	154,182,264円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,355,110円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（ＳＭＡ専用）	175,984,479円
ＦＯＦｓ用　米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	212,622,922円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	503,205,329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】

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

【純資産額計算書】

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	16,305,130,995円
Ⅱ　負債総額	24,374,450円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	16,280,756,545円
Ⅳ　発行済口数	14,057,092,610口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1582円
（1万口当たり純資産額）	（11,582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

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	514,014,453,682円
Ⅱ　負債総額	758,060,690円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	513,256,392,992円
Ⅳ　発行済口数	259,357,316,097口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9790円
（1万口当たり純資産額）	（19,790円）

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	10,225,069,868円
Ⅱ　負債総額	53,145,759円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,171,924,109円
Ⅳ　発行済口数	9,578,301,934口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0620円
（1万口当たり純資産額）	（10,620円）

日本債券ツイン戦略マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	90,207,289,099円
Ⅱ　負債総額	4,723,551,130円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	85,483,737,969円
Ⅳ　発行済口数	91,698,017,557口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9322円
（1万口当たり純資産額）	（9,322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

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	520,409,645,700円
Ⅱ　負債総額	350,011,400円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	520,059,634,300円
Ⅳ　発行済口数	121,611,575,664口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.2764円
（1万口当たり純資産額）	（42,764円）

外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	9,862,150,654円
Ⅱ　負債総額	8,535,565円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,853,615,089円
Ⅳ　発行済口数	8,840,772,397口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1146円
（1万口当たり純資産額）	（11,146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

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	290,956,156,328円
Ⅱ　負債総額	85,448,597円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	290,870,707,731円
Ⅳ　発行済口数	96,834,005,630口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0038円
（1万口当たり純資産額）	（30,038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

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	104,541,931,088円
Ⅱ　負債総額	7,650,616,572円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	96,891,314,516円
Ⅳ　発行済口数	52,682,346,123口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8392円
（1万口当たり純資産額）	（18,392円）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	126,026,198,234円
Ⅱ　負債総額	845,585,704円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	125,180,612,530円
Ⅳ　発行済口数	61,508,217,895口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0352円
（1万口当たり純資産額）	（20,352円）

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	85,636,364,154円
Ⅱ　負債総額	5,676,137円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	85,630,688,017円

Ⅳ　発行済口数	34,867,344,191口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4559円
（1万口当たり純資産額）	（24,559円）

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	22,415,107,641円
Ⅱ　負債総額	9,474,360円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,405,633,281円
Ⅳ　発行済口数	39,649,151,469口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.5651円
（1万口当たり純資産額）	（5,651円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	32,609,373,401円
Ⅱ　負債総額	462,511,137円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	32,146,862,264円
Ⅳ　発行済口数	25,133,265,967口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2791円
（1万口当たり純資産額）	（12,791円）

米国株式ＬＳマザーファンド

純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	19,938,081,900円
Ⅱ　負債総額	30,415,026円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	19,907,666,874円
Ⅳ　発行済口数	19,294,924,931口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0318円
（1万口当たり純資産額）	（10,318円）

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	24,310,246,292円
Ⅱ　負債総額	9,340,975円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	24,300,905,317円
Ⅳ　発行済口数	19,660,645,589口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2360円
（1万口当たり純資産額）	（12,360円）

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 1月31日現在）

Ⅰ　資産総額	8,388,851,511円
Ⅱ　負債総額	89,971円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	8,388,761,540円
Ⅳ　発行済口数	9,396,581,384口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8927円
（1万口当たり純資産額）	（8,927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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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（2023年 1月31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年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（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、監査等委員以外の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発します。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。

②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

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。

［DO（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－DO－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 4月11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。

2023年1月31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	535	14,137,810
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	209,923
単位型公社債投資信託	52	181,913
合計	654	14,529,647

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
また、第37期事業年度の中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）	当事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）
営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	－
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	－	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	－
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	－	120
システム統合費用	110	－
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	△65	△465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		△3,857	△3,662	△3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	－	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	△587	284	△302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				△3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,379	△349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	△349	1,029	4,360
当期末残高	791	△65	726	60,824

当事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	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44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来に

わたって適用することとしております。
この変更が財務諸表に与える影響はありません。
また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号　2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（未適用の会計基準等）
「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号　2021年6月17日）
(1) 概要
投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。
(2) 適用予定日
2023年3月期の期首より適用予定であります。
(3) 当該会計基準等の適用による影響
「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

（追加情報）
退職給付債務及び費用の算定方法の変更
従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る事業年度末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当事業年度より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。
なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、「重要な会計方針６．引当金の計上基準（2）退職給付引当金」をご参照ください。

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2021年3月31日）		当事業年度 （2022年3月31日）	
建　　物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	〃	535	〃
そ の 他	4	〃	―	〃
計	503	〃	681	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	―	―	3,000

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項
該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日

2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

４．基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	－	－	3,000

２．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

３．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

４．基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リース取引関係）

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）

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、自社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。

①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。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

③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				
	米ドル	投資有価証券関係会社株式	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	△54
	英ポンド	277	－	△1	△1
	カナダドル	111	－	△1	△1
	スイスフラン	139	－	△2	△2
	香港ドル	190	－	△1	△1
	ユーロ	676	－	△18	△18
	買建				
	ユーロ	21	－	0	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 米ドル	投資有価証券 関係会社株式	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す。

2．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

（単位：百万円）

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：百万円）

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

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

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

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

3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

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

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

① 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。

② 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㈱	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

① 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。

② 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)				
その他有価証券	－	3,978	－	3,978
資産計	952	16,107	－	17,060
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	804	(0)	－	804
ヘッジ会計が適用されているもの	－	22	－	22
デリバティブ取引計	804	21	－	826

(*1)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(*2)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額908百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は13,989百万円であります。
(*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額223百万円）は上記に含めておりません。
(*4)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（２）時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

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

デリバティブ取引

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

（注２）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

１．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

２．その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

（デリバティブ取引関係）

第37期中間会計期間（自　2022年4月1日　至　2022年9月30日）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

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

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

原則的処理方法	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価証券 関係会社株式	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おりません。

（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 4月11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

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）

③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。

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

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2022年3月末日現在）
④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。
⑤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。

①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。
②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。
③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。
④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。
⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
⑥ファンド名を「コア投資戦略ファンド」と表示する場合があります。

(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．ＸＢＲＬ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9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　　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」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2021年7月13日から2022年7月11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、コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2022年7月11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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友トラスト・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．ＸＢＲＬ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。

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に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、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．ＸＢＲＬ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3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

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」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2022年7月12日から2023年1月11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、コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2023年1月11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7月12日から2023年1月11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に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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。