

## 【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5月26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】	D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060
【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】	D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 10兆円を上限とします。 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 10兆円を上限とします。 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 10兆円を上限とします。 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060 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】

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060

（以下、上記を総称して、あるいは個別に、「当ファンド」、「各ファンド」又は「ファンド」ということがあります。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

### （７）【申込期間】

2023年 5月27日から2023年11月28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 >

当ファンドは「分配金再投資コース」（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）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日又はその翌営業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】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

各ファンドにつき上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

## &lt; 商品分類表定義 &gt;

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

## (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]



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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

- (1)プル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信

託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

#### <ファンドの特色>

### 1. 投資対象ファンド\*への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式(DR(預託証券)を含みます。)及び債券に分散投資します。

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。投資対象ファンドについては、将来除外又は新たに追加する場合があります。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

- 投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。
- 為替ヘッジ付先進国債券部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損が生じる可能性が高いと委託会社が判断した場合には、為替ヘッジ付先進国債券部分以外においても一時的に為替ヘッジを行うことがあります。

#### ? DR(預託証券)とは

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

### 2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
① 国内株式	TOPIX(東証株価指数)
② 先進国株式	MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)
③ 新興国株式	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)
④ 国内債券及び 為替ヘッジ付 先進国債券	《国内債券》 NOMURA-BPI 総合
	《為替ヘッジ付先進国債券》 FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)
⑤ 先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
⑥ 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバシファイド(円換算ベース)

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

### ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各投資対象ファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

3.

ターゲット・イヤー<sup>※</sup>に近づくにしたいが、原則として1年に1回、各資産の基本組入比率を変更します。

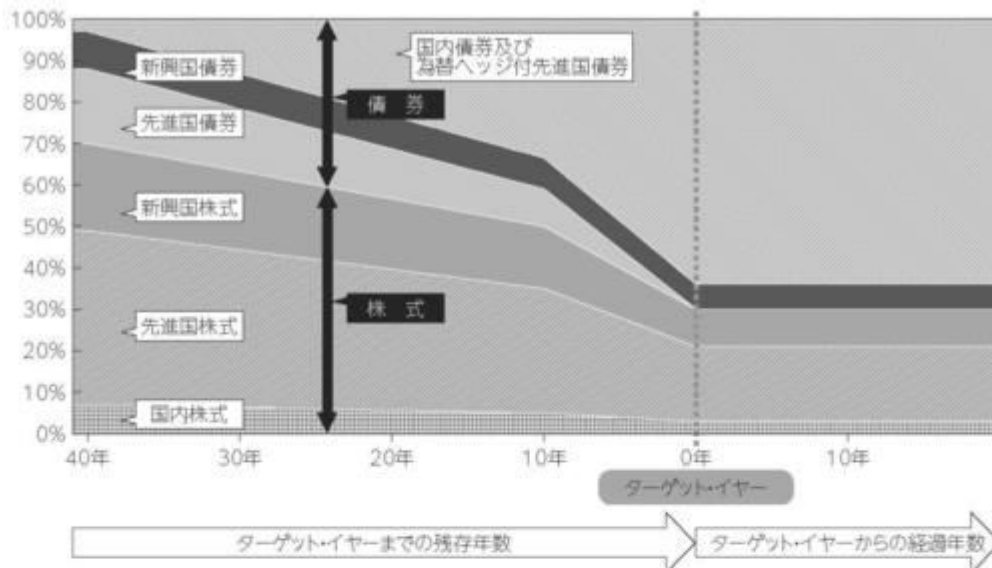
※ターゲット・イヤーとは、ファンドごとにあらかじめ定めた基準日(特定の決算日の翌日)をいいます。

- 定期的に各資産の基本組入比率を変更することで、債券中心の運用へとシフトします。
- ターゲット・イヤー以降の各資産の基本組入比率は一定とすることを基本とします。
- 基本組入比率の最終決定は、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で行います。
- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

#### 各ファンドのターゲット・イヤー

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	2030年8月の決算日の翌日(第13計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	2040年8月の決算日の翌日(第23計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	2050年8月の決算日の翌日(第33計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	2060年8月の決算日の翌日(第43計算期間開始日)

## 基本組入比率の推移のイメージ



※上記は当初設定時における基本組入比率の推移のイメージ図であり、実際のファンドの組入比率と異なる場合があります。

## &lt;ご参考&gt;

## ■ 当初設定時(2019年3月)

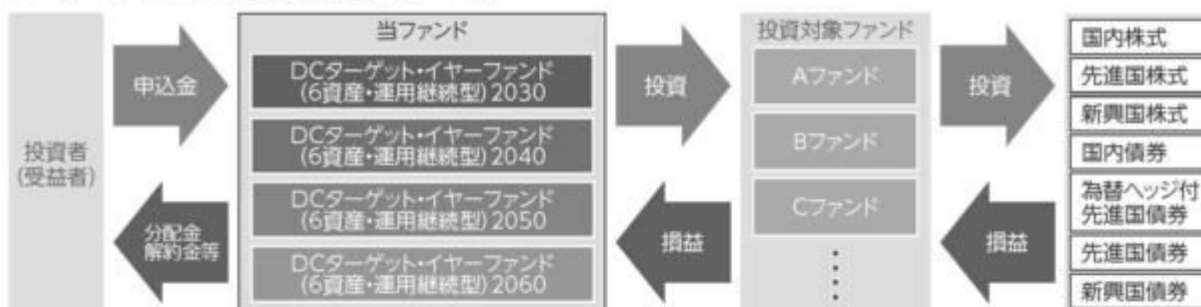
	国内株式	先進国株式	新興国株式	国内債券及び 為替ヘッジ付 先進国債券	先進国債券	新興国債券
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2030	5.1%	30.4%	15.2%	32.4%	9.3%	7.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2040	5.7%	34.4%	17.2%	22.3%	12.3%	8.1%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2050	6.4%	38.4%	19.2%	12.1%	15.3%	8.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2060	7.0%	42.0%	21.0%	3.0%	18.0%	9.0%

## ■ 2023年3月末現在

	国内株式	先進国株式	新興国株式	国内債券及び 為替ヘッジ付 先進国債券	先進国債券	新興国債券
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2030	4.6%	27.6%	13.8%	39.6%	7.2%	7.2%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2040	5.5%	33.2%	16.6%	25.4%	11.4%	7.9%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2050	6.2%	37.2%	18.6%	15.2%	14.4%	8.4%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2060	6.9%	41.2%	20.6%	5.0%	17.4%	8.9%

## ファンドのしくみ

ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



### 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

- 原則として毎年8月28日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 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。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、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。

※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。
- 外貨建資産への直接投資は行いません。ただし、投資対象ファンドを通じた実質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。

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。

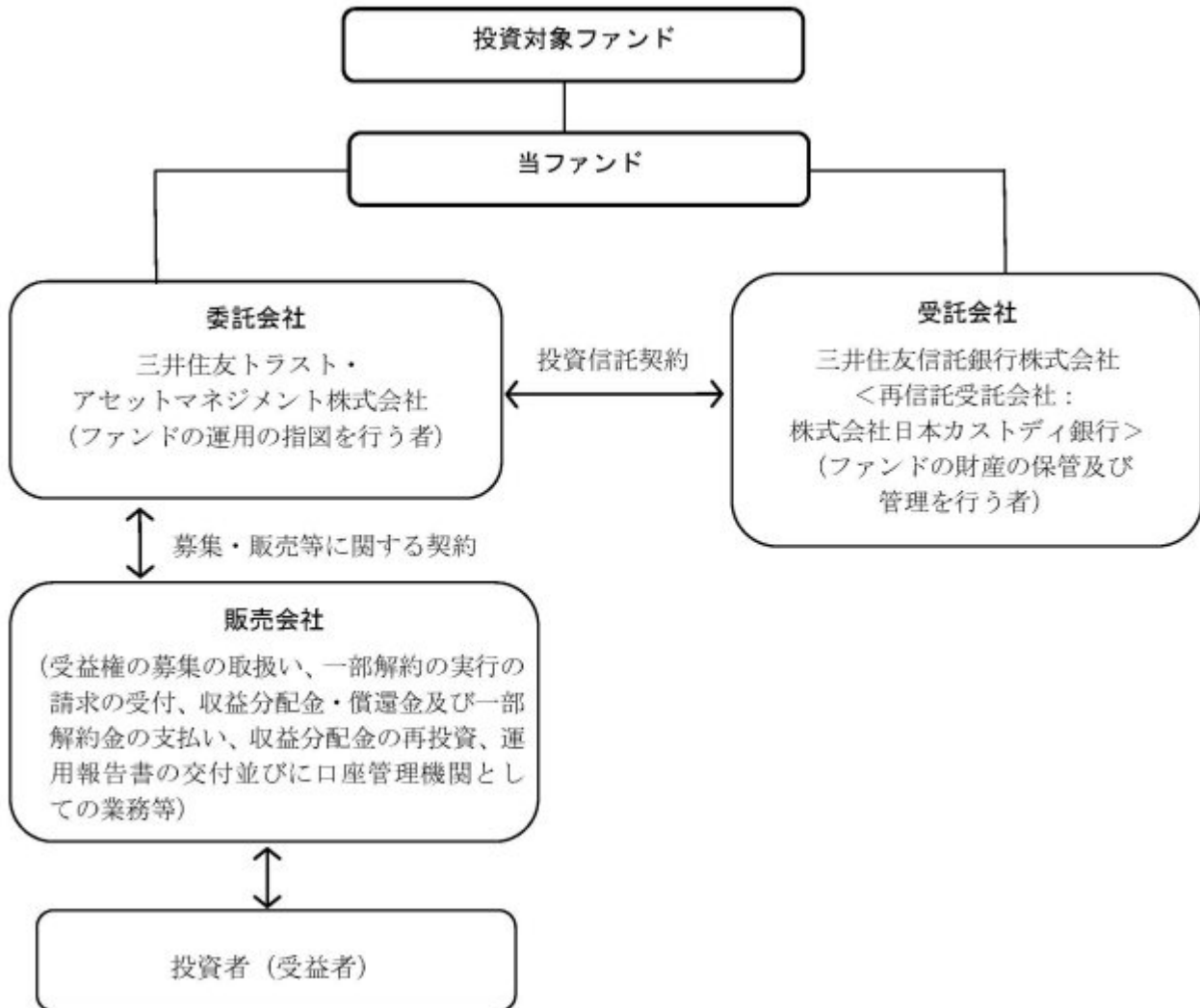
### (2) 【ファンドの沿革】

2019年 3月20日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

### (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2023年 3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】

## 基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の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。

## 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」ということがあります。）を投資対象とします。

## 投資態度

イ．投資対象ファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）及び債券に分散投資します。

ロ．当初設定時の各資産の基本組入比率は以下のとおりとします。

	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2030	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2040	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2050	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2060
国内株式	5.1%	5.7%	6.4%	7.0%
先進国株式	30.4%	34.4%	38.4%	42.0%
新興国株式	15.2%	17.2%	19.2%	21.0%
国内債券 及び為替ヘッジ 付先進国債券	32.4%	22.3%	12.1%	3.0%
先進国債券	9.3%	12.3%	15.3%	18.0%
新興国債券	7.6%	8.1%	8.6%	9.0%

ハ．（１）年8月の決算日の翌日（第（２）計算期間開始日）（以下、「ターゲット・イヤー」といいます。）に近づくにしたいが、定期的に各資産の基本組入比率を変更することで、債券中心の運用へとシフトします。ターゲット・イヤー以降の各資産の基本組入比率は一定とすることを基本とします。なお、基本組入比率の最終決定は、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で行います。基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

上記、（１）及び（２）となっている箇所には下の表より各々の数字をあてはめてお読みください。

	（ 1）	（ 2）
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	2030	13
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	2040	23
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2050	33
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2060	43

ニ．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。

ホ．投資対象ファンドについては、将来除外又は新たに追加する場合があります。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

ヘ．為替ヘッジ付先進国債券部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損が生じる可能性が高いと委託会社が判断した場合には、為替ヘッジ付先進国債券部分以外においても一時的に為替ヘッジを行うことがあります。

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

の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）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

### 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くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）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。

### 金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

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

・全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

以下の内容は、2023年 3月31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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。</p> <p>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。</p>
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J P X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J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」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J P Xが有しています。

J P X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。

J P X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。

J P X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、J P X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。

本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではありません。

J P X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。

J P X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。

以上の項目に限らず、J P X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. 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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。

### 3. 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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。

#### 4.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	<p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

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。

#### 5. 外国債券インデックスマザーファンド（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、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、円ヘッジ・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	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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。公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。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。

<p>主な投資制限</p>	<p>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り、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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年1回：12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1月15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、円ヘッジ・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。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

#### 6. 外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（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、長期的な投資信託財産の成長を目指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	<p>公社債への実質投資は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（ ）に採用されている国の国債等に分散投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>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により為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>公社債等の実質投資割合は、原則として高位を保ちます。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>運用の効率化を図るため、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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>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（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、実質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。</p> <p>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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、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。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年2回：6月・12月の各10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.209%（税抜 0.19%）
信託財産留保額	一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額とします。

設定日	2014年5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

「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。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。

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

主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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。

#### 8. 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・マーケット・グローバル・ディバースファイド（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

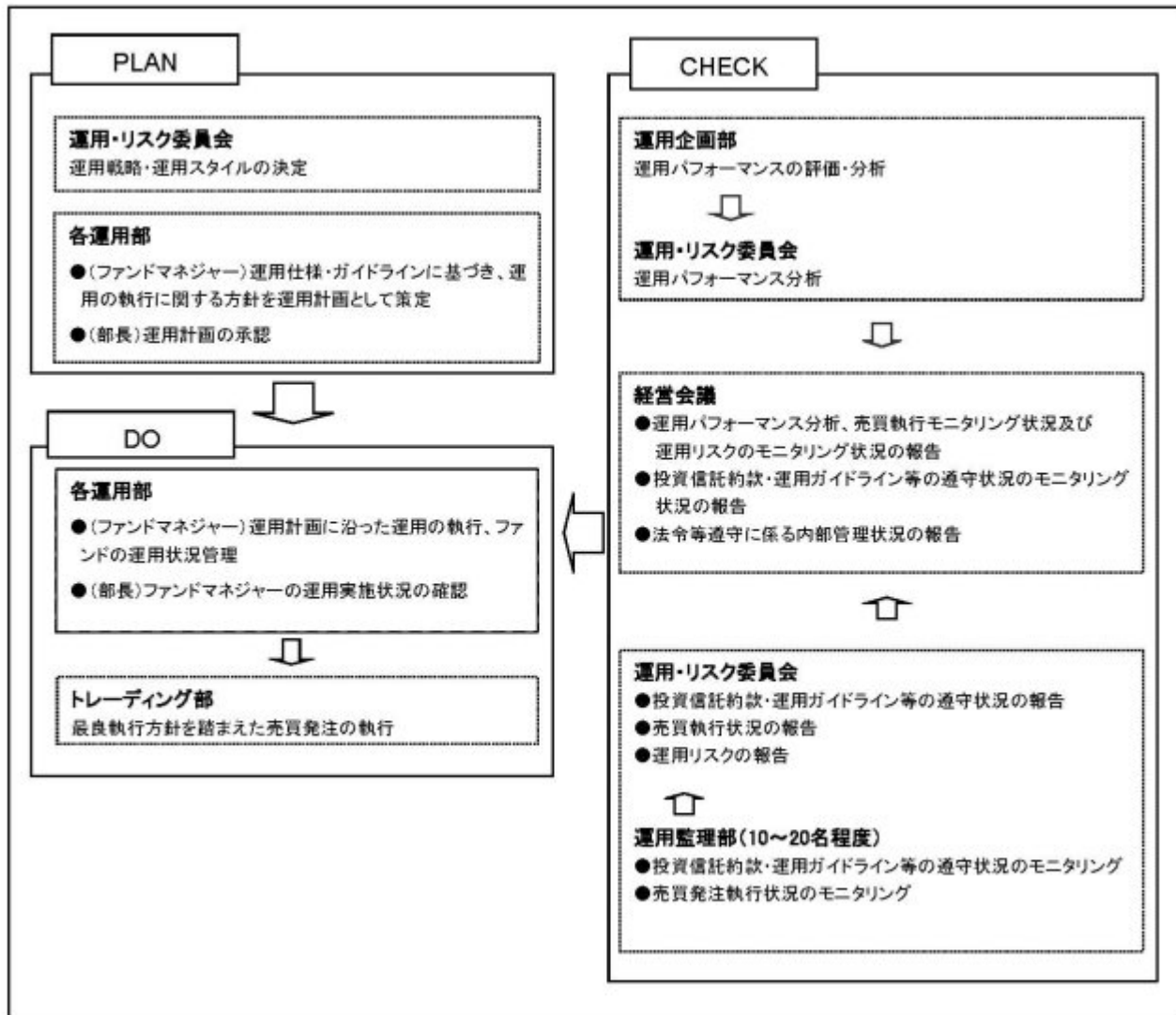
投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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・マーケット・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・マーケット・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て債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティ

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。

### （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）【配分方針】

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です

- ・ 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。
- ・ 分配金額については、委託会社が基準価額水準、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。
- ・ 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．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への直接投資は行いません。ただし、投資対象ファンドを通じた実質投資割合には制限を設けません。

##### ニ．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。

##### ホ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

##### ヘ．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。

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

（二）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ト．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、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### カントリーリスク

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

#### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

同じ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。

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

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

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

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

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

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

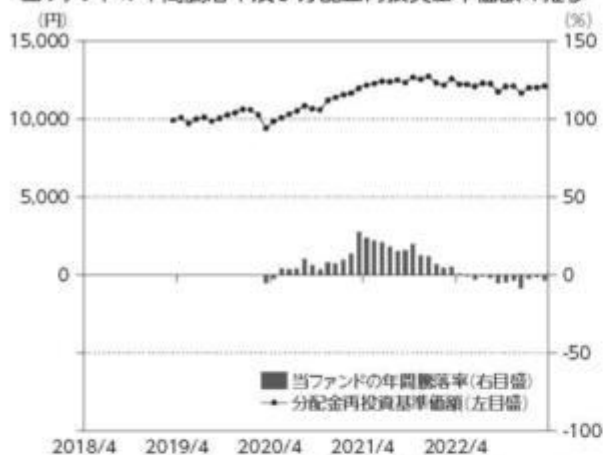
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。



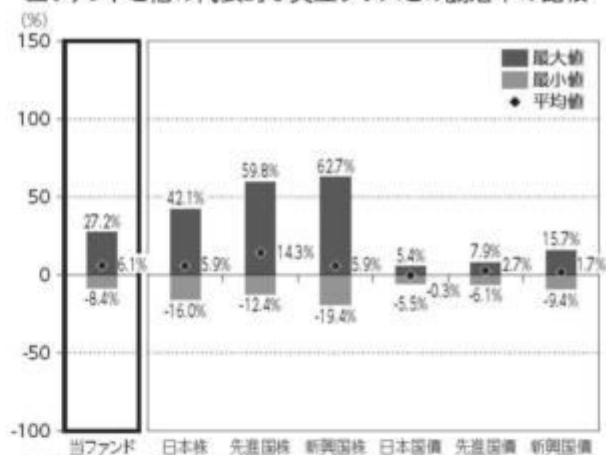
## 【参考情報】

## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030

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

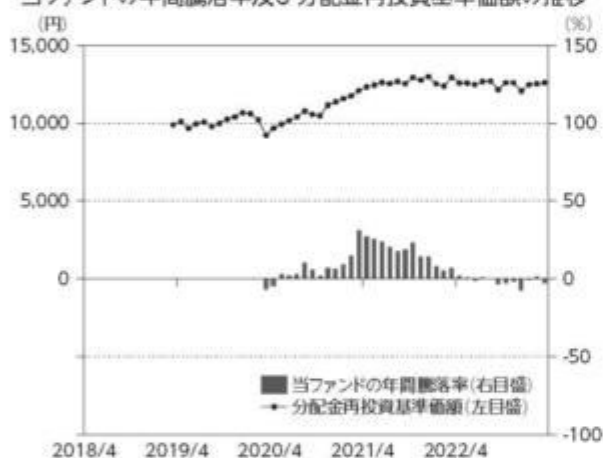


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

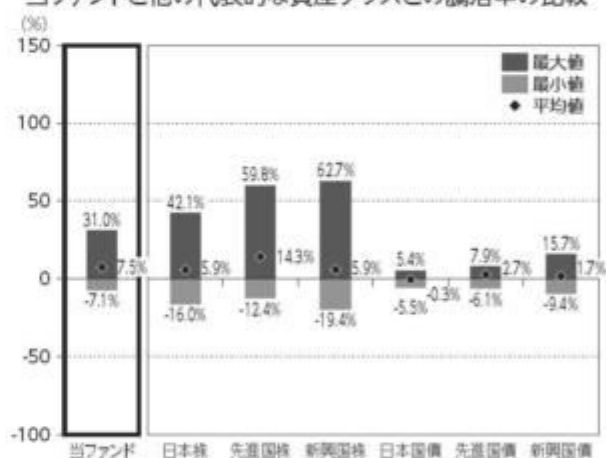


## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040

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

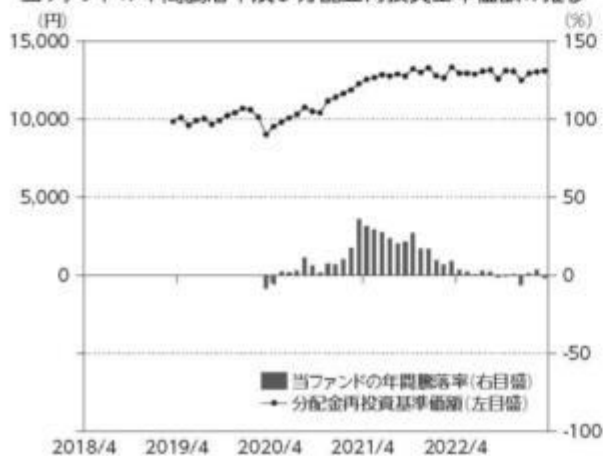


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

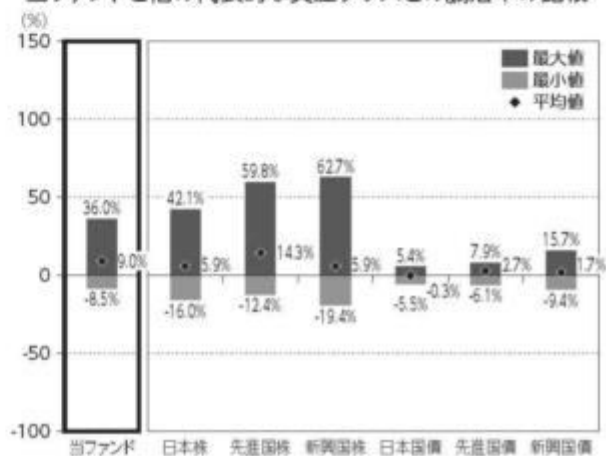


## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050

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



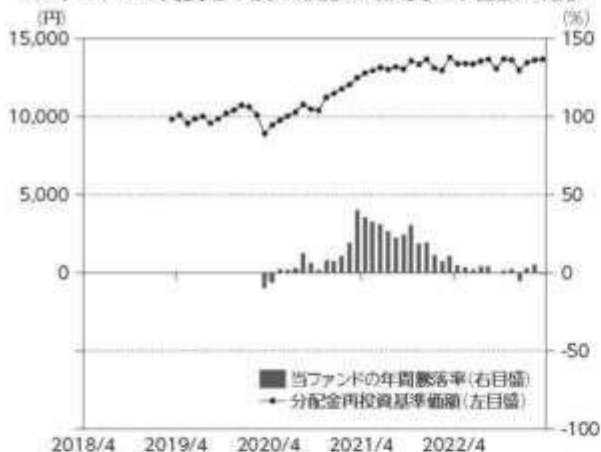
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



## 【参考情報】

## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060

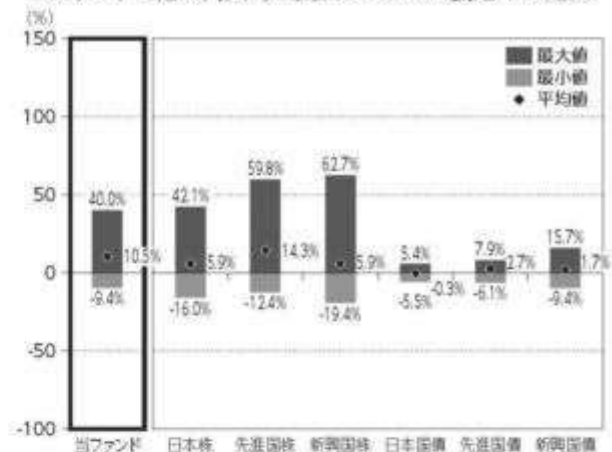
## 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\*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2020年3月～2023年3月の3年1ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2018年4月～2023年3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

<b>日本株</b> 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が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・インテグレートで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX及び株式会社JPXの親会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
<b>先進国株</b> MSCIコフサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコフサイインデックスとは、MSCI Inc.が発行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。
<b>新興国株</b> MSCI Emerging Markets インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets インデックスとは、MSCI Inc.が発行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。
<b>日本国債</b> 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、即日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算出されます。同指数の知的財産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・サービスに一切責任を負いません。
<b>先進国債</b> 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、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
<b>新興国債</b> J.P. Morgan Global Emerging Markets Bond Index (円ベース)	本指数は、信頼性が低いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性、正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用されています。J.P. Morganからの書面による事前承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】

ありません。

## (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。

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

### （ 3 ）【信託報酬等】

#### 信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.374%（税抜 0.34%）（ ）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 0.165% （税抜 0.15%）	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 0.165% （税抜 0.15%）	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 0.044% （税抜 0.04%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「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）。

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

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

なお上記のほかにも、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。
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
外国債券パッシブファンド私募A （為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	年率 0.209% （税抜 0.19%）

外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。

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。

実質的な信託報酬率：上限 年率0.583%（税抜 上限0.53%）  
（投資対象とする投資信託証券：上限 年率0.209%（税抜 上限0.19%））

#### （４）【その他の手数料等】

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

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、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があります。）。

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、2023年 3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3月31日現在の状況について記載してあります。

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

## （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	993,381,107	99.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		9,898,074	0.99
合計（純資産総額）		1,003,279,181	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## （2）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	375,397,737	0.8888	333,672,431	0.8578	322,016,178	32.10
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	62,539,618	4.3680	273,174,644	4.4043	275,443,239	27.45
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	39,091,900	3.6149	141,315,117	3.5195	137,583,942	13.71
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	39,970,216	1.8123	72,440,750	1.8927	75,651,627	7.54
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	23,689,202	3.1323	74,203,286	3.0785	72,927,208	7.27
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	44,829,317	1.3674	61,303,102	1.3649	61,187,534	6.10
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	23,905,591	1.9285	46,103,582	2.0318	48,571,379	4.84

(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、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.01
合計	99.01

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2019年 8月28日)	488,321	488,321	9,766	9,766
第2期計算期間末 (2020年 8月28日)	9,108,305	9,108,305	10,876	10,876
第3期計算期間末 (2021年 8月30日)	168,155,570	168,155,570	12,445	12,445
第4期計算期間末 (2022年 8月29日)	769,603,219	769,603,219	12,340	12,340
2022年 3月末日	347,556,330		12,580	
4月末日	385,410,708		12,234	
5月末日	471,627,036		12,214	
6月末日	695,660,108		12,085	
7月末日	750,584,476		12,295	
8月末日	764,751,792		12,262	
9月末日	795,408,209		11,738	
10月末日	840,090,023		12,087	
11月末日	873,394,360		12,112	
12月末日	872,287,936		11,662	
2023年 1月末日	912,630,562		12,010	
2月末日	916,893,865		12,014	
3月末日	1,003,279,181		12,110	

## 【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
--	-----	--------

第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	2.3
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	11.4
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	14.4
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0.8
第5期中間計算期間	2022年 8月30日～2023年 2月28日	2.6

(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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	10,722,971	2,848,364	8,374,607
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	131,196,373	4,453,274	135,117,706
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	515,248,447	26,679,898	623,686,255
第5期中間計算期間	2022年 8月30日～2023年 2月28日	177,127,309	37,615,368	763,198,196

(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。

#### 【DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040】

##### (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	780,431,524	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,570,529	0.96
合計(純資産総額)		788,002,053	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	59,701,471	4.3634	260,501,753	4.4043	262,943,188	33.37
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(為替ヘッジあり)	176,293,608	0.8861	156,216,654	0.8578	151,224,656	19.19

日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	37,001,614	3.6058	133,421,079	3.5195	130,227,180	16.53
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	28,936,978	3.1277	90,508,935	3.0785	89,082,486	11.30
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	34,588,221	1.8140	62,745,228	1.8927	65,465,125	8.31
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	22,235,342	1.9307	42,930,606	2.0318	45,177,767	5.73
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	26,603,504	1.3665	36,354,117	1.3649	36,311,122	4.61

(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。

#### □.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2019年 8月28日)	482,826	482,826	9,657	9,657
第2期計算期間末	(2020年 8月28日)	10,262,988	10,262,988	10,807	10,807
第3期計算期間末	(2021年 8月30日)	110,076,954	110,076,954	12,614	12,614
第4期計算期間末	(2022年 8月29日)	535,101,335	535,101,335	12,780	12,780
	2022年 3月末日	288,910,159		12,939	
	4月末日	291,976,990		12,573	
	5月末日	351,857,017		12,568	
	6月末日	494,672,508		12,475	
	7月末日	523,666,579		12,673	
	8月末日	531,586,568		12,696	
	9月末日	573,770,811		12,151	



10月末日	619,726,502		12,600
11月末日	638,736,490		12,589
12月末日	642,416,373		12,065
2023年 1月末日	679,204,002		12,465
2月末日	693,787,362		12,527
3月末日	788,002,053		12,602

## 【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	3.4
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	11.9
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	16.7
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	1.3
第5期中間計算期間	2022年 8月30日～2023年 2月28日	2.0

(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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	9,066,056	69,464	9,496,592
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	79,505,469	1,737,885	87,264,176
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	348,173,003	16,742,373	418,694,806
第5期中間計算期間	2022年 8月30日～2023年 2月28日	146,221,586	11,073,149	553,843,243

(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。

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

## （１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	339,754,291	99.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,286,174	0.96
合計（純資産総額）		343,040,465	100.00

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	28,943,190	4.3440	125,730,571	4.4043	127,474,491	37.16
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	17,926,499	3.5715	64,025,502	3.5195	63,092,313	18.39
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	15,812,249	3.1058	49,110,975	3.0785	48,678,008	14.19
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（為替ヘッジあり）	41,602,129	0.8805	36,634,128	0.8578	35,686,306	10.40
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	15,765,756	1.8184	28,669,106	1.8927	29,839,846	8.70
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	10,770,110	1.9384	20,877,098	2.0318	21,882,709	6.38
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	9,598,226	1.3605	13,058,456	1.3649	13,100,618	3.82

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2019年 8月28日)	477,285	477,285	9,546	9,546
第2期計算期間末 (2020年 8月28日)	4,942,635	4,942,635	10,801	10,801
第3期計算期間末 (2021年 8月30日)	45,085,575	45,085,575	12,844	12,844
第4期計算期間末 (2022年 8月29日)	181,774,282	181,774,282	13,247	13,247
2022年 3月末日	97,582,591		13,339	
4月末日	106,020,912		12,953	
5月末日	125,886,806		12,960	
6月末日	169,908,956		12,897	
7月末日	182,149,979		13,085	
8月末日	180,544,923		13,158	
9月末日	201,613,206		12,589	
10月末日	215,377,506		13,120	
11月末日	225,822,592		13,081	
12月末日	231,265,437		12,496	
2023年 1月末日	250,206,229		12,939	
2月末日	274,913,743		13,046	
3月末日	343,040,465		13,109	

#### 【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0

#### 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	4.5
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	13.1
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	18.9

第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	3.1
第5期中間計算期間	2022年 8月30日～2023年 2月28日	1.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	4,213,212	137,106	4,576,106
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	34,461,389	3,934,457	35,103,038
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	122,053,912	19,938,780	137,218,170
第5期中間計算期間	2022年 8月30日～2023年 2月28日	79,971,140	6,469,276	210,720,034

(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。

#### 【DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060】

##### (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	417,670,281	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,014,843	0.95
合計(純資産総額)		421,685,124	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	38,950,124	4.3572	169,714,375	4.4043	171,548,031	40.68
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	24,121,944	3.5835	86,442,341	3.5195	84,897,181	20.13
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	23,920,652	3.0986	74,121,880	3.0785	73,639,727	17.46
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	20,376,488	1.8191	37,068,885	1.8927	38,566,578	9.15
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	14,582,765	1.9406	28,300,267	2.0318	29,629,261	7.03

日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	8,881,049	1.3545	12,030,249	1.3649	12,121,743	2.87
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（為替ヘッジあり）	8,472,558	0.8776	7,436,206	0.8578	7,267,760	1.72

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.05
合計	99.05

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2019年 8月28日)	472,333	472,333	9,447	9,447
第2期計算期間末 (2020年 8月28日)	2,976,184	2,976,184	10,836	10,836
第3期計算期間末 (2021年 8月30日)	37,860,577	37,860,577	13,126	13,126
第4期計算期間末 (2022年 8月29日)	236,061,906	236,061,906	13,780	13,780
2022年 3月末日	121,277,655		13,799	
4月末日	120,823,314		13,392	
5月末日	142,931,141		13,412	
6月末日	184,990,394		13,381	
7月末日	206,689,672		13,561	
8月末日	234,419,571		13,684	
9月末日	226,490,126		13,090	
10月末日	241,167,710		13,709	
11月末日	253,908,751		13,640	
12月末日	270,157,320		12,987	
2023年 1月末日	302,894,827		13,478	

2月末日	352,269,198		13,634	
3月末日	421,685,124		13,683	

## 【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	5.5
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	14.7
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	21.1
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	5.0
第5期中間計算期間	2022年 8月30日～2023年 2月28日	1.1

(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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	2,820,411	573,769	2,746,642
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	33,572,862	7,476,531	28,842,973
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	173,520,838	31,053,827	171,309,984
第5期中間計算期間	2022年 8月30日～2023年 2月28日	127,447,207	40,388,991	258,368,200

(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	517,841,790,170	98.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,618,086,751	1.82
合計(純資産総額)		527,459,876,921	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	9,416,450,000	1.79

(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	9,883,200	2,115.16	20,904,586,696	1,880.00	18,580,416,000	3.52
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,273,200	11,929.59	15,188,754,804	11,985.00	15,259,302,000	2.89
日本	株式	キーエンス	電気機器	180,100	51,554.17	9,284,906,653	64,450.00	11,607,445,000	2.20
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,104,000	739.11	8,207,077,440	847.90	9,415,081,600	1.78
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,313,100	3,982.18	9,211,184,600	3,962.00	9,164,502,200	1.74
日本	株式	第一三共	医薬品	1,572,600	3,556.22	5,592,514,868	4,822.00	7,583,077,200	1.44
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,597,500	3,752.59	5,994,777,772	4,350.00	6,949,125,000	1.32
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,295,400	4,001.25	5,183,231,376	5,298.00	6,863,029,200	1.30
日本	株式	日立製作所	電気機器	884,000	6,772.48	5,986,874,590	7,252.00	6,410,768,000	1.22
日本	株式	信越化学工業	化学	1,498,500	3,632.53	5,443,349,748	4,275.00	6,406,087,500	1.21
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	381,000	19,559.96	7,452,346,418	16,040.00	6,111,240,000	1.16
日本	株式	任天堂	その他製品	1,136,400	5,830.39	6,625,662,004	5,131.00	5,830,868,400	1.11
日本	株式	三井物産	卸売業	1,393,400	3,195.66	4,452,837,787	4,116.00	5,735,234,400	1.09
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,395,000	4,529.02	6,317,986,470	4,093.00	5,709,735,000	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,190,700	4,483.20	5,338,147,615	4,751.00	5,657,015,700	1.07
日本	株式	HOYA	精密機器	384,400	13,936.77	5,357,298,120	14,560.00	5,596,864,000	1.06
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,043,800	5,369.37	5,604,555,736	5,182.00	5,408,971,600	1.03

日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,463,100	3,189.09	4,665,972,189	3,510.00	5,135,481,000	0.97
日本	株式	ダイキン工業	機械	217,000	20,710.23	4,494,121,367	23,655.00	5,133,135,000	0.97
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,173,400	3,730.14	4,376,951,702	4,301.00	5,046,793,400	0.96
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,369,900	4,674.50	6,403,604,371	3,650.00	5,000,135,000	0.95
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,563,700	1,539.56	3,946,995,292	1,878.00	4,814,628,600	0.91
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,785,000	2,477.07	4,421,573,825	2,547.00	4,546,395,000	0.86
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	979,500	3,935.92	3,855,238,893	4,528.00	4,435,176,000	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,900,100	1,492.18	4,327,496,895	1,529.00	4,434,252,900	0.84
日本	株式	村田製作所	電気機器	545,900	8,204.37	4,478,768,712	8,040.00	4,389,036,000	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	883,500	4,264.19	3,767,418,021	4,760.00	4,205,460,000	0.80
日本	株式	S M C	機械	58,900	66,087.57	3,892,557,873	69,830.00	4,112,987,000	0.78
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	656,300	5,413.70	3,553,017,038	5,975.00	3,921,392,500	0.74
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,166,700	2,371.27	2,766,561,247	2,798.00	3,264,426,600	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	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.29
		建設業	1.93
		食料品	3.47
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.19
		医薬品	5.45
		石油・石炭製品	0.45
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	0.71
		鉄鋼	0.92
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.57
		機械	5.31
		電気機器	17.75
		輸送用機器	7.32
		精密機器	2.54
		その他製品	2.21
		電気・ガス業	1.19
陸運業	2.90		



	海運業	0.60
	空運業	0.48
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	8.50
	卸売業	6.06
	小売業	4.46
	銀行業	5.81
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	2.10
	その他金融業	1.07
	不動産業	1.81
	サービス業	4.99
	小計	98.18
合計		98.18

(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	東証株価指数先物	買建	470円		9,286,594,300	9,416,450,000	1.79

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

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

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	356,259,366,449	65.52
	イギリス	23,260,235,999	4.28
	カナダ	18,995,347,370	3.49
	フランス	18,551,475,982	3.41
	スイス	17,582,176,544	3.23
	ドイツ	13,900,782,655	2.56
	オーストラリア	11,122,386,992	2.05

	オランダ	10,668,367,628	1.96
	アイルランド	9,717,826,804	1.79
	スウェーデン	5,046,353,359	0.93
	デンマーク	4,976,403,516	0.92
	スペイン	4,288,249,921	0.79
	香港	3,325,223,658	0.61
	イタリア	2,921,330,809	0.54
	フィンランド	1,963,628,285	0.36
	シンガポール	1,837,451,852	0.34
	ジャージー	1,633,870,316	0.30
	ベルギー	1,378,822,613	0.25
	ケイマン	1,100,695,517	0.20
	イスラエル	1,083,410,200	0.20
	ノルウェー	1,075,994,165	0.20
	バミューダ	797,093,920	0.15
	キュラソー	727,446,873	0.13
	ニュージーランド	450,986,862	0.08
	ルクセンブルク	349,420,399	0.06
	ポルトガル	299,758,405	0.06
	オーストリア	296,274,509	0.05
	リベリア	147,917,526	0.03
	パナマ	114,449,599	0.02
	マン島	102,709,285	0.02
	小計	513,975,458,012	94.53
投資信託受益証券	オーストラリア	117,643,472	0.02
	香港	55,724,760	0.01
	小計	173,368,232	0.03
投資証券	アメリカ	9,464,358,970	1.74
	オーストラリア	620,153,911	0.11
	イギリス	239,428,507	0.04
	シンガポール	234,383,053	0.04
	フランス	210,244,859	0.04
	香港	146,170,332	0.03
	カナダ	53,638,205	0.01
	ベルギー	51,260,997	0.01
	小計	11,019,638,834	2.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		18,559,051,881	3.41
合計(純資産総額)		543,727,516,959	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	13,729,020,480	2.52
	買建	カナダ	687,414,550	0.13
	買建	ドイツ	2,824,764,713	0.52
	買建	イギリス	706,848,486	0.13
	買建	オーストラリア	624,376,935	0.11

(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		941,087,703	0.17

(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	1,262,821	20,025.49	25,288,614,485	21,679.93	27,377,871,893	5.04
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	562,164	36,468.76	20,501,425,332	37,929.19	21,322,428,821	3.92
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	727,070	15,417.78	11,209,807,897	13,620.05	9,902,737,024	1.82
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	196,006	25,038.21	4,907,639,449	36,564.51	7,166,865,288	1.32
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	474,294	14,991.75	7,110,498,692	13,471.84	6,389,613,687	1.18
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	433,996	15,080.87	6,545,040,815	13,529.25	5,871,644,549	1.08
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	213,069	33,684.29	7,177,078,616	26,075.73	5,555,931,505	1.02
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	179,617	26,008.97	4,671,653,775	27,752.87	4,984,888,185	0.92
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	327,418	13,015.16	4,261,400,636	14,620.19	4,786,916,545	0.88

アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	74,171	67,755.92	5,025,524,937	62,767.11	4,655,499,449	0.86
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	207,999	24,089.42	5,010,577,181	20,487.50	4,261,381,156	0.78
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービ ス	103,354	42,521.09	4,394,725,266	40,737.33	4,210,366,253	0.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	232,844	17,521.18	4,079,702,011	17,191.98	4,003,051,137	0.74
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービ ス	128,824	28,420.52	3,661,245,739	29,691.73	3,825,007,529	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	187,873	19,833.21	3,726,124,831	19,688.99	3,699,031,215	0.68
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲 料・タバコ	218,301	17,014.39	3,714,259,748	16,185.75	3,533,367,244	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービ ス	67,952	47,754.33	3,245,002,497	47,971.98	3,259,792,515	0.60
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	146,184	23,741.63	3,470,647,025	21,683.93	3,169,844,603	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費 財・サービ ス流通・小 売り	80,884	41,185.49	3,331,247,698	38,104.12	3,082,013,707	0.57
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	140,386	20,002.23	2,808,033,645	21,087.05	2,960,327,668	0.54
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半 導体製造装 置	31,858	78,844.72	2,511,835,103	90,885.56	2,895,432,298	0.53
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	43,142.20	2,732,627,435	45,492.33	2,881,484,543	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	201,265	12,446.73	2,505,092,708	14,143.49	2,846,591,044	0.52
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半 導体製造装 置	33,103	77,783.93	2,574,881,627	84,624.63	2,801,329,375	0.52
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	131,448	14,562.93	1,914,268,288	21,116.97	2,775,784,261	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲 料・タバコ	326,933	8,617.71	2,817,416,610	8,258.83	2,700,084,232	0.50
フランス	株式	LVMH	耐久消費 財・アパレ ル	22,026	87,400.84	1,925,091,093	120,510.43	2,654,362,951	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバコ	108,690	22,933.77	2,492,672,277	24,146.22	2,624,453,728	0.48
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	445,597	7,146.01	3,184,244,264	5,391.94	2,402,632,912	0.44
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	31,133	76,355.30	2,377,169,844	75,173.38	2,340,372,967	0.43

(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	不動産管理・開発	0.31
		エネルギー	5.12
		素材	4.23
		資本財	6.55
		商業・専門サービス	1.53
		運輸	1.82
		自動車・自動車部品	1.90
		耐久消費財・アパレル	1.73
		消費者サービス	2.03
		メディア・娯楽	5.19
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.96
		生活必需品流通・小売り	1.80
		食品・飲料・タバコ	4.15
		家庭用品・パーソナル用品	1.78
		ヘルスケア機器・サービス	4.52
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.65
		銀行	5.27
		金融サービス	6.39
		保険	3.08
		エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.04
		ソフトウェア・サービス	8.42
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.48
		電気通信サービス	1.41
公益事業	3.00		
半導体・半導体製造装置	5.17		
	小計	94.53	
投資信託受益証券			0.03
投資証券			2.03
合計			96.59

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	504	アメリカドル	98,874,408.2	13,202,699,727	102,816,000	13,729,020,480	2.52
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	29	カナダドル	6,846,674.5	676,109,107	6,961,160	687,414,550	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	56	スイスフラン	5,922,782	865,673,817	6,120,240	894,534,278	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	313	ユーロ	12,862,248.5	1,874,286,851	13,246,160	1,930,230,435	0.35
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	39	オーストラリアドル	6,855,848	614,901,007	6,961,500	624,376,935	0.11
	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	56	イギリスポンド	4,236,295	701,361,000	4,269,440	706,848,486	0.13

(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	5,490,000.00	727,740,500	732,752,421	0.13
	カナダドル	買建	930,000.00	90,779,160	91,801,602	0.02
	ユーロ	買建	800,000.00	116,528,800	116,533,680	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。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン	22,994,374,514	17.76
	台湾	18,309,196,365	14.14
	インド	16,039,018,689	12.39
	中国	15,233,833,825	11.77
	韓国	14,725,663,478	11.38
	ブラジル	5,900,865,018	4.56
	サウジアラビア	4,856,294,803	3.75
	南アフリカ	4,260,196,220	3.29
	メキシコ	3,098,602,369	2.39

	タイ	2,630,067,383	2.03
	インドネシア	2,365,302,488	1.83
	マレーシア	1,802,444,681	1.39
	アラブ首長国連邦	1,539,625,219	1.19
	香港	1,407,818,922	1.09
	カタール	1,105,417,665	0.85
	クウェート	1,071,977,238	0.83
	フィリピン	910,628,650	0.70
	ポーランド	794,838,305	0.61
	トルコ	768,621,293	0.59
	チリ	716,005,569	0.55
	バミューダ	655,316,951	0.51
	アメリカ	630,598,914	0.49
	ギリシャ	475,523,099	0.37
	チェコ	249,994,226	0.19
	ハンガリー	195,699,738	0.15
	ルクセンブルク	131,099,522	0.10
	コロンビア	101,553,624	0.08
	エジプト	69,033,942	0.05
	オランダ	29,861,934	0.02
	シンガポール	24,715,360	0.02
	ペルー	18,492,223	0.01
	ロシア	131	0.00
	キプロス	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	123,112,682,358	95.10
投資信託受益証券	ブラジル	223,209,792	0.17
	メキシコ	104,155,271	0.08
	小計	327,365,063	0.25
投資証券	メキシコ	72,274,002	0.06
	南アフリカ	46,614,232	0.04
	小計	118,888,234	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,891,021,736	4.55
合計(純資産総額)		129,449,957,391	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,876,306,786	4.54

(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		113,451,285	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	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	3,484,389	1,879.45	6,548,751,661	2,342.76	8,163,104,596	6.31
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	887,900	4,101.93	3,642,107,849	6,548.85	5,814,723,915	4.49
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	674,568	6,402.68	4,319,044,908	6,515.92	4,395,431,123	3.40
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2,106,688	1,199.82	2,527,665,748	1,648.26	3,472,388,523	2.68
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	651,350	2,422.42	1,577,847,431	2,415.42	1,573,283,817	1.22
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	428,842	4,236.96	1,816,990,133	3,665.80	1,572,053,292	1.21
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	13,765,620	76.75	1,056,608,399	86.24	1,187,156,705	0.92
ブラジル	株式	VALE SA	素材	539,487	1,964.56	1,059,855,511	2,142.71	1,155,964,374	0.89
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	474,628	2,480.19	1,177,169,990	2,268.93	1,076,902,454	0.83
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	金融サービス	244,058	4,131.67	1,008,368,276	4,268.51	1,041,764,014	0.80
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	722,114	1,484.41	1,071,918,753	1,395.64	1,007,811,183	0.78
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	307,661	3,044.16	936,570,671	2,776.03	854,076,781	0.66
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	316,200	1,468.49	464,336,786	2,542.99	804,095,019	0.62
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	895,500	640.12	573,229,377	864.10	773,808,714	0.60
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	31,120	16,819.94	523,436,786	24,848.52	773,286,079	0.60



台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,689,248	447.67	756,237,715	457.60	773,009,176	0.60
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	72,095	8,362.30	602,880,507	10,207.03	735,876,059	0.57
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	280,025	3,026.59	847,522,362	2,618.80	733,330,870	0.57
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	210,804	2,872.36	605,505,384	3,406.86	718,180,137	0.55
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	77,344	9,213.95	712,643,756	9,155.27	708,105,976	0.55
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	128,434	5,304.03	681,219,041	5,146.48	660,983,526	0.51
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	118,503	5,832.93	691,219,934	5,505.54	652,423,007	0.50
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	282,030	1,698.45	479,014,193	2,311.65	651,957,188	0.50
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	7,642,300	78.86	602,720,690	78.54	600,245,348	0.46
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	11,607,200	45.66	530,024,973	51.37	596,264,185	0.46
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	8,099,515	62.58	506,875,245	72.63	588,289,643	0.45
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7,779	75,462.92	587,026,055	74,335.10	578,252,743	0.45
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE CV	電気通信サービス	3,945,440	146.16	576,678,945	142.64	562,813,939	0.43
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	7,328	72,801.67	533,490,706	71,757.60	525,839,693	0.41
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	319,099	1,990.88	635,290,844	1,633.63	521,291,454	0.40

(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	不動産管理・開発	1.72
		エネルギー	4.49
		素材	8.25
		資本財	3.67
		商業・専門サービス	0.06
		運輸	1.92
		自動車・自動車部品	3.10
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	2.65
		メディア・娯楽	7.27
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.60
		生活必需品流通・小売り	1.55

	食品・飲料・タバコ	3.77
	家庭用品・パーソナル用品	0.82
	ヘルスケア機器・サービス	0.97
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.67
	銀行	14.61
	金融サービス	2.92
	保険	2.54
	ソフトウェア・サービス	2.34
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.04
	電気通信サービス	2.93
	公益事業	2.54
	半導体・半導体製造装置	9.15
	小計	95.10
投資信託受益証券		0.25
投資証券		0.09
合計		95.45

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	882	アメリカドル	42,445,748	5,667,780,730	44,007,390	5,876,306,786	4.54

(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	850,000.00	112,599,500	113,451,285	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。

#### 国内債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	533,593,815,020	84.63
地方債証券	日本	32,204,051,236	5.11
特殊債券	日本	35,943,447,416	5.70
社債券	日本	26,669,367,000	4.23
	フランス	794,579,000	0.13
	スペイン	396,288,000	0.06
	小計	27,860,234,000	4.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		909,372,763	0.14
合計(純資産総額)		630,510,920,435	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	8,820,000,000	100.33	8,849,784,000	100.29	8,845,842,600	0.100	2024/9/20	1.40
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	6,660,000,000	100.06	6,663,996,000	100.01	6,661,198,800	0.005	2026/12/20	1.06
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,420,000,000	100.29	6,439,104,500	100.02	6,421,540,800	0.100	2028/3/20	1.02
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	6,517,000,000	98.76	6,436,665,500	98.05	6,389,983,670	0.100	2031/12/20	1.01
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,170,000,000	100.12	6,177,404,000	100.16	6,179,872,000	0.005	2026/6/20	0.98
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	100.51	5,930,503,000	100.43	5,925,547,000	0.100	2026/9/20	0.94
日本	国債証券	第140回利付国債(5年)	5,870,000,000	100.29	5,887,455,100	100.26	5,885,320,700	0.100	2024/6/20	0.93
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	100.48	5,777,600,000	100.31	5,768,170,000	0.100	2027/3/20	0.91
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	5,650,000,000	99.01	5,594,596,600	98.19	5,548,243,500	0.100	2031/6/20	0.88
日本	国債証券	第151回利付国債(5年)	5,370,000,000	99.87	5,363,019,000	99.94	5,366,778,000	0.005	2027/3/20	0.85
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,370,000,000	99.71	5,354,427,000	99.04	5,318,448,000	0.200	2032/3/20	0.84
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	5,260,000,000	101.27	5,326,946,800	100.86	5,305,709,400	0.600	2024/6/20	0.84
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,120,000,000	100.46	5,143,848,000	100.43	5,142,118,400	0.100	2025/9/20	0.82
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	5,110,000,000	100.45	5,132,995,000	100.39	5,130,388,900	0.100	2025/6/20	0.81

日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	5,120,000,000	100.39	5,140,009,200	100.09	5,124,761,600	0.100	2027/12/20	0.81
日本	国債証券	第153回利付国債（5年）	5,100,000,000	99.87	5,093,492,500	99.85	5,092,452,000	0.005	2027/6/20	0.81
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	5,020,000,000	101.21	5,080,742,000	100.99	5,069,798,400	0.300	2025/12/20	0.80
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,110,000,000	99.01	5,059,411,000	98.10	5,013,165,500	0.100	2031/9/20	0.80
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	5,000,000,000	100.26	5,013,075,200	99.97	4,998,700,000	0.100	2028/6/20	0.79
日本	国債証券	第154回利付国債（5年）	4,950,000,000	99.91	4,945,545,000	100.17	4,958,811,000	0.100	2027/9/20	0.79
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	4,900,000,000	99.82	4,891,180,000	99.59	4,880,106,000	0.200	2032/6/20	0.77
日本	国債証券	第149回利付国債（5年）	4,820,000,000	100.10	4,824,820,000	100.10	4,825,012,800	0.005	2026/9/20	0.77
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	4,730,000,000	100.32	4,745,176,800	101.69	4,810,173,500	0.500	2032/12/20	0.76
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	4,840,000,000	99.46	4,813,864,000	98.90	4,786,760,000	0.100	2030/9/20	0.76
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	100.49	4,783,514,400	100.45	4,781,848,400	0.100	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	4,790,000,000	100.06	4,793,209,300	99.73	4,777,258,600	0.100	2029/3/20	0.76
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	4,710,000,000	99.20	4,672,735,000	98.64	4,645,944,000	0.100	2030/12/20	0.74
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	4,660,000,000	99.84	4,652,815,900	99.63	4,642,758,000	0.100	2029/6/20	0.74
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	101.27	4,618,231,200	100.96	4,603,867,200	0.400	2025/3/20	0.73
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	4,480,000,000	100.43	4,499,264,000	100.37	4,496,710,400	0.100	2025/3/20	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.63
地方債証券	5.11
特殊債券	5.70
社債券	4.42
合計	99.86

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 外国債券インデックスマザーファンド（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（％）
国債証券	アメリカ	32,639,197,870	48.80
	フランス	5,586,436,701	8.35
	イタリア	5,072,981,261	7.59
	ドイツ	4,312,173,090	6.45
	スペイン	3,338,321,290	4.99
	イギリス	3,187,909,583	4.77
	中国	3,068,919,942	4.59
	カナダ	1,353,564,808	2.02
	ベルギー	1,246,497,272	1.86
	オーストラリア	1,050,798,991	1.57
	オランダ	1,016,475,620	1.52
	オーストリア	803,157,859	1.20
	メキシコ	574,779,500	0.86
	アイルランド	427,453,360	0.64
	マレーシア	369,008,911	0.55
	フィンランド	348,888,473	0.52
	ポーランド	313,477,368	0.47
	シンガポール	285,478,992	0.43
	イスラエル	215,788,844	0.32
	デンマーク	215,484,202	0.32
ニュージーランド	145,220,576	0.22	
スウェーデン	138,630,366	0.21	
ノルウェー	131,590,704	0.20	
	小計	65,842,235,583	98.45
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,035,217,394	1.55
合計（純資産総額）		66,877,452,977	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	94,543,414	0.14
	買建	ドイツ	71,937,592	0.11

(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	売建		65,059,021,446	97.28

(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 2.625% 05/31/27	4,500,000	12,692.13	571,145,885	12,761.76	574,279,411	2.625	2027/5/31	0.86
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	3,630,000	12,895.55	468,108,662	12,957.10	470,342,889	3.125	2028/11/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	3,580,000	12,592.50	450,811,676	12,638.92	452,473,603	2.875	2032/5/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	3,700,000	12,015.61	444,577,702	12,142.36	449,267,423	1.125	2026/10/31	0.67
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	3,400,000	13,010.82	442,368,199	13,082.02	444,788,951	3.125	2025/8/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 4.25% 10/15/25	3,300,000	13,398.37	442,146,519	13,433.32	443,299,776	4.250	2025/10/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 0.625% 10/15/24	3,500,000	12,471.75	436,511,396	12,616.23	441,568,323	0.625	2024/10/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	3,750,000	11,061.62	414,810,945	11,140.36	417,763,734	1.250	2031/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	3,410,000	11,474.19	391,269,921	11,547.99	393,786,725	1.625	2031/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	3,000,000	12,466.27	373,988,321	12,609.45	378,283,711	0.750	2024/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	2,910,000	12,837.57	373,573,410	12,921.89	376,027,181	2.250	2024/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/28	3,160,000	11,752.72	371,386,154	11,864.08	374,905,189	1.500	2028/11/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.5% 02/15/25	2,870,000	12,564.19	360,592,517	12,705.69	364,653,373	1.500	2025/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.25% 10/31/24	2,800,000	12,829.77	359,233,764	12,929.19	362,017,564	2.250	2024/10/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	3,190,000	11,117.41	354,645,562	11,188.09	356,900,155	1.125	2031/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	3,160,000	11,116.37	351,277,371	11,209.99	354,235,999	1.375	2031/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	2,650,000	12,892.68	341,656,194	12,989.44	344,220,258	2.375	2024/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.625% 04/15/25	2,600,000	12,918.01	335,868,465	12,961.01	336,986,426	2.625	2025/4/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.875% 09/30/26	2,500,000	11,924.85	298,121,375	12,059.16	301,479,183	0.875	2026/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	2,630,000	10,894.17	286,516,678	10,994.31	289,150,557	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 3% 07/31/24	2,200,000	12,988.06	285,737,375	13,102.89	288,263,624	3.000	2024/7/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	2,200,000	12,643.36	278,153,944	12,756.28	280,638,332	1.500	2024/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	2,200,000	12,550.25	276,105,613	12,729.68	280,053,094	0.250	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	2,180,000	12,753.15	278,018,850	12,830.61	279,707,430	2.875	2028/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.5% 05/31/24	2,100,000	12,955.27	272,060,853	13,047.60	273,999,649	2.500	2024/5/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	2,330,000	11,615.54	270,642,201	11,732.64	273,370,621	1.250	2028/9/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	2,200,000	12,025.00	264,550,054	12,184.35	268,055,737	0.750	2026/3/31	0.40

アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	1,900,000	13,634.20	259,049,802	13,955.97	265,163,456	4.125	2032/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	2,260,000	11,577.46	261,650,783	11,658.83	263,489,742	1.875	2032/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	2,150,000	11,991.09	257,808,613	12,144.44	261,105,657	0.750	2026/4/30	0.39

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.45
合計	98.45

(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	2	アメリカドル	218,005.6	29,110,288	218,562.5	29,184,651	0.04
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	2	アメリカドル	229,239.98	30,610,414	229,156.26	30,599,235	0.05
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	2	アメリカドル	260,380.6	34,768,622	260,312.5	34,759,528	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	1	ユーロ	105,937.1	15,437,154	105,650	15,395,318	0.02
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	1	ユーロ	118,362.1	17,247,725	117,580	17,133,757	0.03
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	2	ユーロ	274,554.2	40,008,038	270,440	39,408,517	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	売建	241,088,000.00	32,696,549,193	32,141,345,874	48.06
	カナダドル	売建	13,503,000.00	1,341,241,259	1,331,511,925	1.99
	メキシコペソ	売建	79,056,000.00	580,508,208	580,729,564	0.87
	ユーロ	売建	150,855,000.00	21,672,930,541	21,960,656,283	32.84

イギリスポンド	売建	18,834,000.00	3,071,378,134	3,113,791,318	4.66
スウェーデンクローナ	売建	10,587,000.00	137,382,291	136,447,372	0.20
ノルウェークローネ	売建	10,155,000.00	132,802,012	130,270,371	0.19
デンマーククローネ	売建	10,856,000.00	209,613,076	212,172,920	0.32
ポーランドズロチ	売建	10,059,000.00	305,745,885	312,563,307	0.47
オーストラリアドル	売建	11,439,000.00	1,040,095,285	1,024,795,987	1.53
ニュージーランドドル	売建	1,717,000.00	143,661,946	143,514,242	0.21
シンガポールドル	売建	2,785,000.00	280,158,262	279,788,062	0.42
マレーシアリングット	売建	12,335,000.00	373,078,495	372,488,629	0.56
イスラエルシェケル	売建	5,815,000.00	216,154,598	215,356,780	0.32
オフショア人民元	売建	159,992,000.00	3,125,110,305	3,103,588,812	4.64

(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	146,722,108,864	48.74
	フランス	25,102,099,399	8.34
	イタリア	22,732,332,648	7.55
	ドイツ	19,387,144,335	6.44
	スペイン	15,012,552,647	4.99
	イギリス	14,355,261,664	4.77
	中国	13,746,006,518	4.57
	カナダ	6,060,616,161	2.01
	ベルギー	5,575,628,461	1.85
	オーストラリア	4,707,226,619	1.56
	オランダ	4,580,385,068	1.52
	オーストリア	3,601,202,451	1.20
	メキシコ	2,576,253,249	0.86
	アイルランド	1,902,077,841	0.63
	マレーシア	1,641,006,084	0.55
	フィンランド	1,556,082,145	0.52
	ポーランド	1,381,136,443	0.46
	シンガポール	1,301,079,491	0.43
	イスラエル	965,349,102	0.32
	デンマーク	964,929,420	0.32
ニュージーランド	664,050,022	0.22	



	スウェーデン	618,579,229	0.21
	ノルウェー	587,392,237	0.20
	小計	295,740,500,098	98.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,278,110,182	1.75
合計(純資産総額)		301,018,610,280	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,183,820,662	0.39
	買建	ドイツ	1,062,836,506	0.35

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

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

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		2,303,741,076	0.77

(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	12,376.78	1,707,996,220	12,496.53	1,724,521,181	2.750	2032/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	13,340,000	13,226.77	1,764,451,449	12,606.32	1,681,684,068	2.625	2029/2/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	12,857.47	1,671,472,216	12,806.43	1,664,836,950	0.250	2024/3/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	12,450,000	12,915.81	1,608,018,956	12,742.72	1,586,469,416	2.000	2025/8/15	0.53
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	79,870,000	1,927.43	1,539,441,380	1,923.62	1,536,399,393	1.990	2025/4/9	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	13,380,000	11,707.91	1,566,518,411	11,140.36	1,490,581,002	1.250	2031/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,078.98	1,528,933,897	12,641.27	1,477,765,010	2.375	2027/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	11,530,000	12,772.99	1,472,725,871	12,547.90	1,446,773,788	2.250	2027/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	12,293.62	1,454,336,095	12,032.82	1,423,483,364	0.750	2026/8/31	0.47

アメリカ	国債証券	T 0.5% 04/30/27	11,940,000	11,765.13	1,404,756,798	11,708.91	1,398,044,078	0.500	2027/4/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	12,772.97	1,387,145,526	12,609.45	1,369,387,032	0.750	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,022.57	1,409,045,236	11,658.83	1,366,415,828	1.875	2032/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	12,050,000	11,703.90	1,410,320,493	11,188.09	1,348,165,166	1.125	2031/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/31/25	10,900,000	12,225.73	1,332,605,632	12,302.49	1,340,971,887	0.250	2025/5/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	13,245.02	1,344,370,385	12,921.89	1,311,572,469	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	12,000,000	11,352.72	1,362,326,472	10,881.13	1,305,735,619	0.625	2030/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,291.63	1,349,349,859	10,829.75	1,294,155,422	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	12,180.43	1,358,119,024	11,547.99	1,287,601,755	1.625	2031/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	12,687.92	1,281,480,180	12,638.92	1,276,531,676	2.875	2032/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	12,796.19	1,279,619,032	12,729.68	1,272,968,610	0.250	2024/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/29	9,800,000	12,663.01	1,240,974,996	12,769.06	1,251,368,569	2.875	2029/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	11,030,000	11,743.96	1,295,359,174	11,209.99	1,236,462,999	1.375	2031/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,497.14	1,281,931,300	10,994.31	1,225,866,434	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	12,087.07	1,234,090,150	11,676.83	1,192,204,692	1.125	2028/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	12,043.03	1,144,088,204	12,144.44	1,153,722,674	0.750	2026/4/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	12,764.63	1,148,817,010	12,689.26	1,142,033,583	0.250	2024/6/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	12,772.45	1,150,798,419	12,673.35	1,141,869,116	0.375	2024/7/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/30/27	9,880,000	11,315.89	1,118,010,703	11,503.92	1,136,587,541	0.375	2027/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	13,060.38	1,168,904,149	12,612.06	1,128,779,817	2.250	2027/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	12,977.78	1,142,044,702	12,756.28	1,122,553,328	1.500	2024/11/30	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	98.25
合計	98.25

(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	32	アメリカドル	3,475,105.32	464,030,813	3,497,000	466,954,410	0.16
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	23	アメリカドル	2,608,580.08	348,323,698	2,635,296.99	351,891,207	0.12
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	21	アメリカドル	2,695,308.8	359,904,584	2,733,281.25	364,975,045	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	13	ユーロ	1,371,517.3	199,857,501	1,373,450	200,139,134	0.07

ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	17	ユーロ	1,988,965.7	289,832,082	1,998,860	291,273,879	0.10
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	29	ユーロ	3,897,320.9	567,917,601	3,921,380	571,423,493	0.19

(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	8,870,000.00	1,168,915,947	1,182,016,200	0.39
	カナダドル	買建	1,020,000.00	98,465,794	100,541,400	0.03
	ユーロ	買建	5,350,000.00	760,208,103	778,612,250	0.26
	イギリスポンド	買建	590,000.00	95,130,577	97,506,350	0.03
	オフショア人民元	買建	7,480,000.00	143,708,016	145,064,876	0.05

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

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	タイ	10,309,269,627	10.08
	ブラジル	10,240,098,069	10.01
	メキシコ	9,943,441,714	9.72
	マレーシア	9,932,941,232	9.71
	インドネシア	9,881,042,483	9.66
	中国	9,858,358,841	9.64
	南アフリカ	9,666,575,125	9.45
	ポーランド	7,237,032,522	7.08
	チェコ	5,831,428,958	5.70
	コロンビア	3,676,666,149	3.59
	ルーマニア	3,604,099,141	3.52
	ハンガリー	3,126,827,176	3.06
	ペルー	2,321,076,026	2.27
	チリ	2,260,719,207	2.21
	ドミニカ共和国	186,195,244	0.18
ウルグアイ	131,025,157	0.13	

	フィリピン	71,605,381	0.07
	小計	98,278,402,052	96.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,008,331,661	3.92
合計(純資産総額)		102,286,733,713	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	95,100,000	2,279.33	2,167,652,108	2,388.60	2,271,560,565	0.000	2024/1/1	2.22
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	2.45	1,600,456,276	2.68	1,756,210,076	9.850	2027/6/28	1.72
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	210,400,000	792.02	1,666,430,157	796.67	1,676,201,780	10.500	2026/12/21	1.64
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	63,800,000	2,505.02	1,598,205,543	2,539.57	1,620,248,574	10.000	2025/1/1	1.58
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	1,821.30	1,393,297,393	1,914.19	1,464,357,470	0.000	2026/1/1	1.43
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	212,600,000	661.28	1,405,902,128	680.03	1,445,756,163	8.000	2030/1/31	1.41
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	57,700,000	2,441.71	1,408,871,567	2,457.52	1,417,992,043	10.000	2027/1/1	1.39
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	655.92	1,149,841,765	663.85	1,163,729,693	5.750	2026/3/5	1.14
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	51,250,000	2,177.39	1,115,917,487	2,265.25	1,160,942,121	0.000	2024/7/1	1.13
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	158,100,000	658.84	1,041,633,110	687.55	1,087,018,953	7.750	2031/5/29	1.06
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000	639.61	1,058,564,019	650.24	1,076,154,399	8.250	2032/3/31	1.05
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	176,700,000	586.46	1,036,286,443	573.35	1,013,126,237	8.750	2048/2/28	0.99
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	686.28	953,931,391	695.61	966,903,879	7.500	2027/6/3	0.95
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000	633.85	957,124,447	639.38	965,469,614	8.875	2035/2/28	0.94
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	46,400,000	1,945.81	902,856,036	2,034.67	944,089,262	0.000	2025/7/1	0.92
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	155,300,000	613.13	952,192,503	605.97	941,084,533	9.000	2040/1/31	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	711.63	913,741,262	711.08	913,027,368	8.000	2024/9/5	0.89
マレーシア	国債証券	MGS 3.757% 05/22/40	30,350,000	2,717.58	824,787,193	2,849.83	864,924,839	3.757	2040/5/22	0.85
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	40,600,000,000	1.80	734,596,508	2.04	831,815,093	7.250	2034/10/18	0.81
タイ	国債証券	THAIGB 1.45% 12/17/24	212,000,000	389.33	825,380,888	389.97	826,740,357	1.450	2024/12/17	0.81
タイ	国債証券	THAIGB 2.875% 12/17/28	201,000,000	401.01	806,036,955	409.76	823,635,862	2.875	2028/12/17	0.81
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	136,700,000	594.58	812,796,141	599.46	819,464,759	8.500	2037/1/31	0.80
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000	391.33	794,793,516	395.14	802,545,737	2.125	2026/12/17	0.78

メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	110,100,000	702.64	773,616,270	722.37	795,339,818	8.500	2029/5/31	0.78
タイ	国債証券	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000	417.74	751,936,752	440.71	793,281,102	3.775	2032/6/25	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	104,250,000	737.33	768,675,345	731.63	762,730,021	10.000	2024/12/5	0.75
マレーシア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	27,300,000	2,627.60	717,335,292	2,751.05	751,038,207	2.632	2031/4/15	0.73
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	31,700,000	2,371.72	751,835,278	2,360.02	748,127,825	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	2,925.73	716,805,584	3,006.14	736,504,895	2.500	2024/4/25	0.72
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	23,000,000	3,022.62	695,203,722	3,068.38	705,729,614	3.955	2025/9/15	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	96.08
合計	96.08

(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。

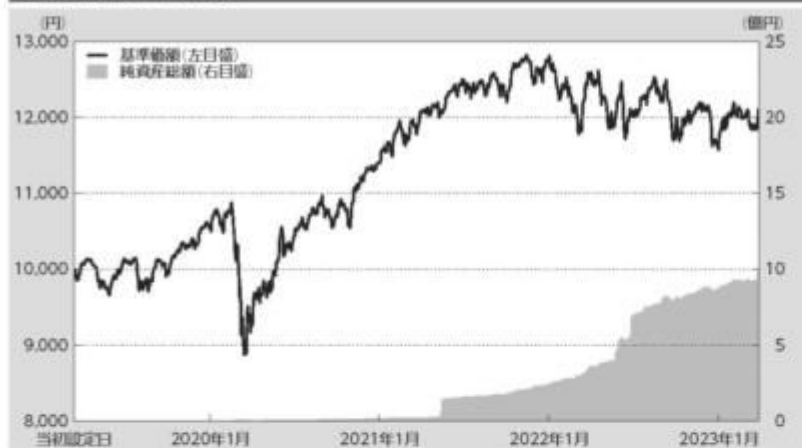
#### 参考情報

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：2019年3月20日

作成基準日：2023年3月31日

**DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030****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 12,110円

純資産総額 10.03億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

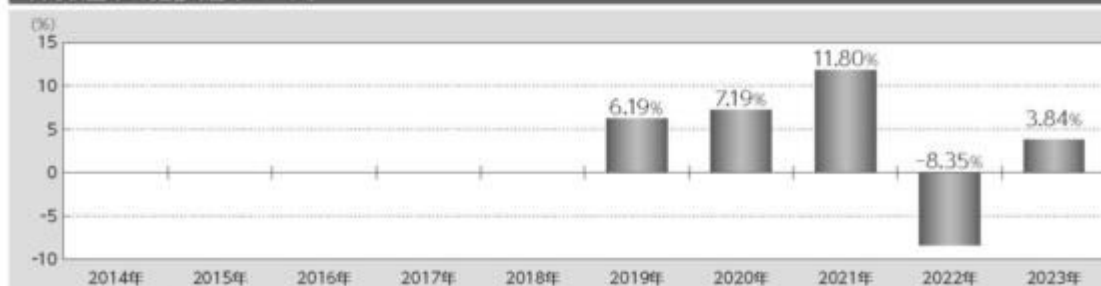
決算期	分配金
2019年 8月	0円
2020年 8月	0円
2021年 8月	0円
2022年 8月	0円
—	—
設定来 分配金合計額	0円

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

**主要な資産の状況**

投資信託証券	投資比率
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	32.1%
外国株式インデックス マザーファンド	27.5%
新興国株式インデックス マザーファンド	13.7%
新興国債券インデックス マザーファンド	7.5%
外国債券インデックス マザーファンド	7.3%
国内債券インデックス マザーファンド	6.1%
国内株式インデックス マザーファンド	4.8%

※ 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)**

※ 2019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。

当初設定日：2019年3月20日

作成基準日：2023年3月31日

## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040

## 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 12.602円

純資産総額 7.88億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

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

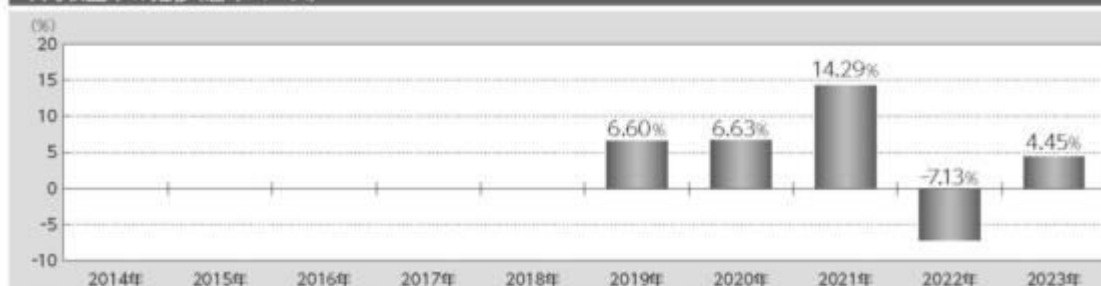
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	33.4%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	19.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	16.5%
外国債券インデックス マザーファンド	11.3%
新興国債券インデックス マザーファンド	8.3%
国内株式インデックス マザーファンド	5.7%
国内債券インデックス マザーファンド	4.6%

※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)




※2019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。

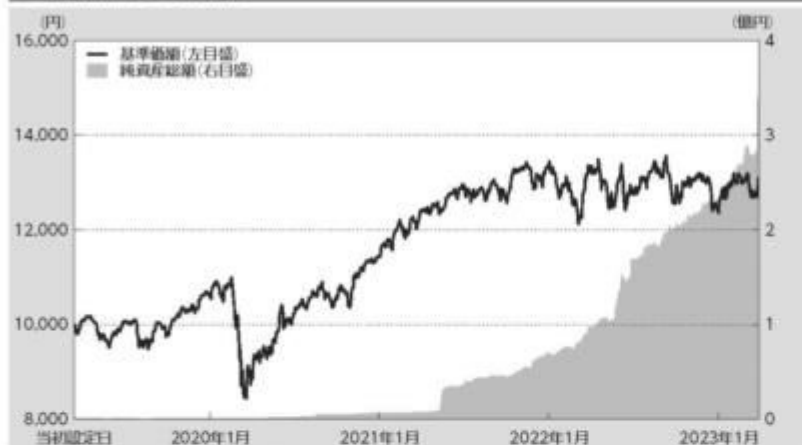
※ファンド内には、ベンチマークはありません。

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。


**運用実績**

当初設定日：2019年3月20日  
作成基準日：2023年3月31日

**DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050**
**基準価額・純資産の推移**


※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	13,109円
------	---------

純資産総額	3.43億円
-------	--------

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

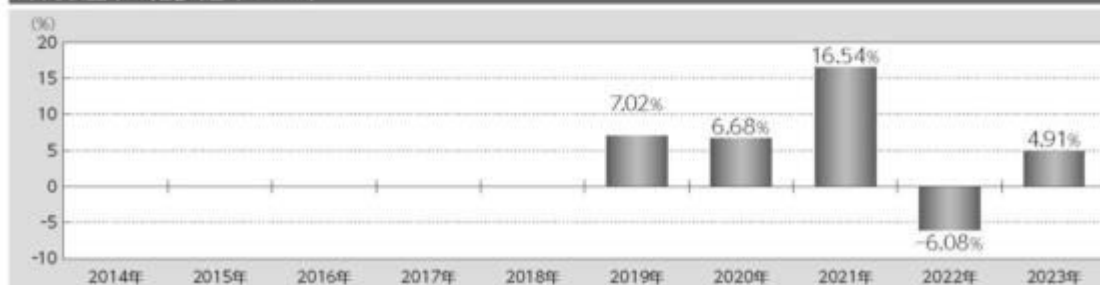
決算期	分配金
2019年 8月	0円
2020年 8月	0円
2021年 8月	0円
2022年 8月	0円
—	—
設定来 分配金合計額	0円

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

**主要な資産の状況**

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	37.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	18.4%
外国債券インデックス マザーファンド	14.2%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	10.4%
新興国債券インデックス マザーファンド	8.7%
国内株式インデックス マザーファンド	6.4%
国内債券インデックス マザーファンド	3.8%

※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)**


※2019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。

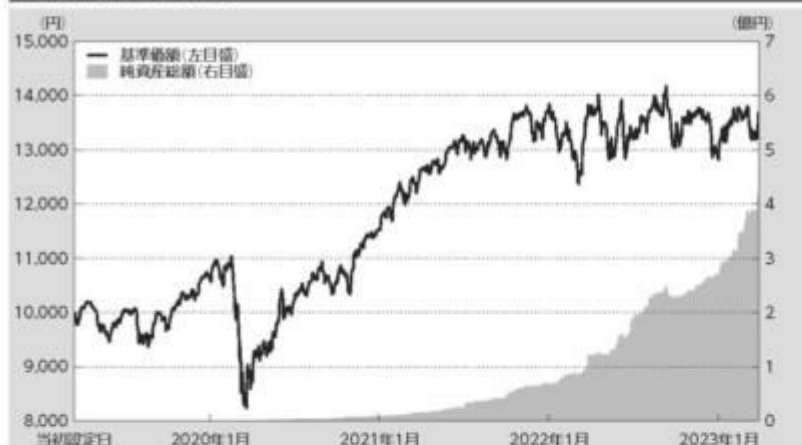


当初設定日：2019年3月20日

作成基準日：2023年3月31日

## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060

## 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 13,683円

純資産総額 4.22億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

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

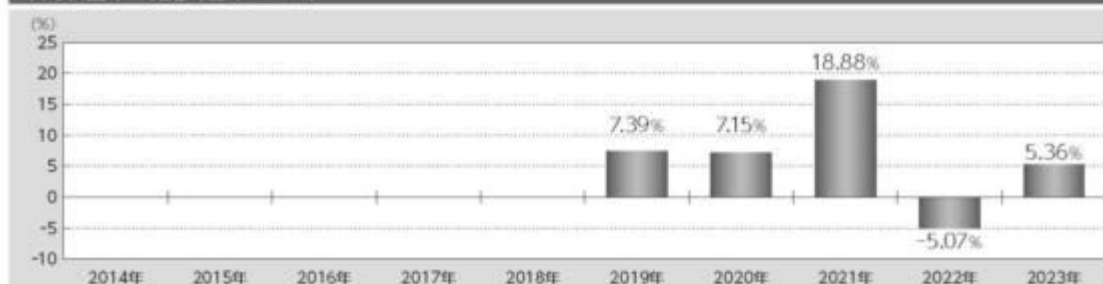
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	40.7%
新興国株式インデックス マザーファンド	20.1%
外国債券インデックス マザーファンド	17.5%
新興国債券インデックス マザーファンド	9.1%
国内株式インデックス マザーファンド	7.0%
国内債券インデックス マザーファンド	2.9%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	1.7%

※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)



※2019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】

## &lt; 申込手続 &gt;

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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 >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

「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 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 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、申込日当日又はその翌営業日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（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。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより、振り込まれることとなります。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

#### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

#### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

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

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

##### ・国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

##### ・外貨建資産等の円換算

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

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2019年3月20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8月29日から翌年8月28日までとします。

ただし、第1計算期間は2019年3月20日から2019年8月28日までとします。

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

#### (5)【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

##### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

### (1)投資信託約款の変更等

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

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、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 >

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

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

### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてとします。）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。

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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



権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

(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8月31日から2022年8月29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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2021年 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,221,474	8,384,350
投資信託受益証券	48,680,554	-
親投資信託受益証券	116,472,968	761,957,083
未収入金	-	776,715
流動資産合計	168,374,996	771,118,148
資産合計	168,374,996	771,118,148
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	492,227
未払受託者報酬	21,683	112,082
未払委託者報酬	195,091	896,654
未払利息	5	14
その他未払費用	2,647	13,952
流動負債合計	219,426	1,514,929
負債合計	219,426	1,514,929
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	135,117,706	623,686,255
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	33,037,864	145,916,964
(分配準備積立金)	6,527,591	12,369,612
元本等合計	168,155,570	769,603,219
純資産合計	168,155,570	769,603,219
負債純資産合計	168,374,996	771,118,148

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自 至	2020年 8月29日 2021年 8月30日	自 至	2021年 8月31日 2022年 8月29日
営業収益				
受取配当金		327,481		398,807
受取利息		1		28
有価証券売買等損益		6,231,322		4,997,591
営業収益合計		6,558,804		5,396,426
営業費用				
支払利息		286		1,256
受託者報酬		24,673		160,423
委託者報酬		221,972		1,331,658
その他費用		2,957		19,935
営業費用合計		249,888		1,513,272
営業利益又は営業損失（ ）		6,308,916		3,883,154
経常利益又は経常損失（ ）		6,308,916		3,883,154
当期純利益又は当期純損失（ ）		6,308,916		3,883,154
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（ ）		145,798		392,856
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		733,698		33,037,864
剰余金増加額又は欠損金減少額		26,958,961		114,976,720
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		26,958,961		114,976,720
剰余金減少額又は欠損金増加額		817,913		6,373,630
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		817,913		6,373,630
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		33,037,864		145,916,964

## (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. 収益及び費用の計上基準	(2)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。
3. その他	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。
	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28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 8月31日から2022年 8月29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 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	135,117,706口	623,686,255口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2445円 (12,445円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2340円 (12,340円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日																								
<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,176,536円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>4,986,582円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>26,510,273円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,176,536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	4,986,582円	収益調整金額	C	26,510,273円	<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>6,425,084円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>133,547,352円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	6,425,084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	133,547,352円
項目																									
費用控除後の配当等収益額	A	1,176,536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	4,986,582円																							
収益調整金額	C	26,510,273円																							
項目																									
費用控除後の配当等収益額	A	6,425,084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	133,547,352円																							

第3期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日			第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日		
分配準備積立金額	D	364,473円	分配準備積立金額	D	5,944,528円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	33,037,864円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	145,916,964円
当ファンドの期末残存口数	F	135,117,706口	当ファンドの期末残存口数	F	623,686,255口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,445円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,339円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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 8月29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

	第4期 (2022年 8月29日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## ( 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 8月29日 至 2021年 8月30日	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,374,607円	135,117,706円
期中追加設定元本額	131,196,373円	515,248,447円
期中一部解約元本額	4,453,274円	26,679,898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 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29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	540,535	-
親投資信託受益証券	5,017,649	15,694,603
合計	5,558,184	15,694,603

## ( デリバティブ取引に関する注記 )

該当事項はありません。

#### （４）【附属明細表】

##### 第１ 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	29,668,579	108,889,618	
	国内株式インデックス マザーファンド	18,069,483	34,740,388	
	外国株式インデックス マザーファンド	47,783,273	210,098,273	
	国内債券インデックス マザーファンド	33,482,313	45,971,215	
	外国債券インデックス マザーファンド	17,693,076	55,793,345	
	新興国債券インデックス マザーファンド	30,863,900	55,801,931	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	278,668,498	250,662,313	
合計		456,229,122	761,957,083	

(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。



## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

(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8月31日から2022年8月29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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2021年 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,079,059	6,556,225
投資信託受益証券	20,117,255	-
親投資信託受益証券	88,146,633	529,787,662
未収入金	-	612,389
流動資産合計	110,342,947	536,956,276
資産合計	110,342,947	536,956,276
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	126,444	1,114,307
未払受託者報酬	13,794	81,013
未払委託者報酬	124,095	649,536
未払利息	3	10
その他未払費用	1,657	10,075
流動負債合計	265,993	1,854,941
負債合計	265,993	1,854,941
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	87,264,176	418,694,806
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	22,812,778	116,406,529
(分配準備積立金)	5,228,396	14,789,422
元本等合計	110,076,954	535,101,335
純資産合計	110,076,954	535,101,335
負債純資産合計	110,342,947	536,956,276

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	2020年 8月29日	自	2021年 8月31日
	至	2021年 8月30日	至	2022年 8月29日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		128,249		151,011
受取利息		-		16
有価証券売買等損益		4,688,072		11,078,745
<b>営業収益合計</b>		<b>4,816,321</b>		<b>11,229,772</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		142		753
受託者報酬		16,564		110,113
委託者報酬		148,958		911,376
その他費用		1,938		13,646
<b>営業費用合計</b>		<b>167,602</b>		<b>1,035,888</b>
営業利益又は営業損失（ ）		4,648,719		10,193,884
経常利益又は経常損失（ ）		4,648,719		10,193,884
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,648,719		10,193,884
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（ ）		79,753		142,445
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		766,396		22,812,778
剰余金増加額又は欠損金減少額		17,723,308		87,909,937
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		17,723,308		87,909,937
剰余金減少額又は欠損金増加額		245,892		4,367,625
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		245,892		4,367,625
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		22,812,778		116,406,529

## (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. 収益及び費用の計上基準	(2)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。
3. その他	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。
	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28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 8月31日から2022年 8月29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 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	87,264,176口	418,694,806口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2614円 (12,614円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2780円 (12,780円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日																								
分配金の計算過程	分配金の計算過程																								
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>784,163円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>3,784,803円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>17,584,382円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	784,163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	3,784,803円	収益調整金額	C	17,584,382円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>5,358,748円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>4,692,691円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>101,617,107円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	5,358,748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	4,692,691円	収益調整金額	C	101,617,107円
項目																									
費用控除後の配当等収益額	A	784,163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	3,784,803円																							
収益調整金額	C	17,584,382円																							
項目																									
費用控除後の配当等収益額	A	5,358,748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	4,692,691円																							
収益調整金額	C	101,617,107円																							

第3期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日			第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日		
分配準備積立金額	D	659,430円	分配準備積立金額	D	4,737,983円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	22,812,778円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	116,406,529円
当ファンドの期末残存口数	F	87,264,176口	当ファンドの期末残存口数	F	418,694,806口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,614円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,780円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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 8月29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

	第4期 (2022年 8月29日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## ( 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 8月29日 至 2021年 8月30日	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,496,592円	87,264,176円
期中追加設定元本額	79,505,469円	348,173,003円
期中一部解約元本額	1,737,885円	16,742,373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 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29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	183,380	-
親投資信託受益証券	4,215,164	15,458,593
合計	4,398,544	15,458,593

## ( デリバティブ取引に関する注記 )

該当事項はありません。

#### （４）【附属明細表】

##### 第１ 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	24,801,771	91,027,459	
	国内株式インデックス マザーファンド	15,014,672	28,867,208	
	外国株式インデックス マザーファンド	39,946,205	175,639,468	
	国内債券インデックス マザーファンド	17,839,373	24,493,459	
	外国債券インデックス マザーファンド	19,468,895	61,393,213	
	新興国債券インデックス マザーファンド	23,534,761	42,550,847	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	117,638,698	105,816,008	
合計		258,244,375	529,787,662	

(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。

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

(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8月31日から2022年8月29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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2021年 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	621,932	2,205,488
投資信託受益証券	4,353,149	-
親投資信託受益証券	40,165,935	179,969,007
未収入金	-	1,368,123
流動資産合計	45,141,016	183,542,618
資産合計	45,141,016	183,542,618
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	1,505,122
未払受託者報酬	5,489	28,763
未払委託者報酬	49,304	230,917
未払利息	1	3
その他未払費用	647	3,531
流動負債合計	55,441	1,768,336
負債合計	55,441	1,768,336
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	35,103,038	137,218,170
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,982,537	44,556,112
(分配準備積立金)	2,098,867	6,120,706
元本等合計	45,085,575	181,774,282
純資産合計	45,085,575	181,774,282
負債純資産合計	45,141,016	183,542,618

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自 至	2020年 8月29日 2021年 8月30日	自 至	2021年 8月31日 2022年 8月29日
営業収益				
受取配当金		24,664		36,949
受取利息		-		4
有価証券売買等損益		2,111,686		4,804,345
営業収益合計		2,136,350		4,841,298
営業費用				
支払利息		56		232
受託者報酬		6,759		41,667
委託者報酬		60,540		346,929
その他費用		723		5,081
営業費用合計		68,078		393,909
営業利益又は営業損失（ ）		2,068,272		4,447,389
経常利益又は経常損失（ ）		2,068,272		4,447,389
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,068,272		4,447,389
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（ ）		213,019		30,013
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		366,529		9,982,537
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,578,279		35,887,760
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,578,279		35,887,760
剰余金減少額又は欠損金増加額		817,524		5,791,587
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		817,524		5,791,587
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,982,537		44,556,112



## (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)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8月29日から翌年8月28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 8月31日から2022年 8月29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 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	35,103,038口	137,218,170口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2844円 (12,844円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3247円 (13,247円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日			第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	319,645円	費用控除後の配当等収益額	A	2,102,478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	1,535,608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	2,374,924円
収益調整金額	C	7,883,670円	収益調整金額	C	38,435,406円

第3期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日			第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日		
分配準備積立金額	D	243,614円	分配準備積立金額	D	1,643,304円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,982,537円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	44,556,112円
当ファンドの期末残存口数	F	35,103,038口	当ファンドの期末残存口数	F	137,218,170口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,843円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,247円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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 8月29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

	第4期 (2022年 8月29日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （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 8月29日 至 2021年 8月30日	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	4,576,106円	35,103,038円
期中追加設定元本額	34,461,389円	122,053,912円
期中一部解約元本額	3,934,457円	19,938,780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 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29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	33,100	-
親投資信託受益証券	1,903,451	5,537,154
合計	1,936,551	5,537,154

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

#### （４）【附属明細表】

##### 第１ 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	9,435,952	34,631,831	
	国内株式インデックス マザーファンド	5,748,222	11,051,531	
	外国株式インデックス マザーファンド	15,200,930	66,836,969	
	国内債券インデックス マザーファンド	4,477,976	6,148,261	
	外国債券インデックス マザーファンド	8,351,944	26,337,020	
	新興国債券インデックス マザーファンド	8,498,619	15,365,503	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	21,787,540	19,597,892	
合計		73,501,183	179,969,007	

(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。

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

(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8月31日から2022年8月29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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2021年 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	442,462	3,119,402
投資信託受益証券	336,834	-
親投資信託受益証券	37,142,251	233,722,733
未収入金	-	5,959,281
流動資産合計	37,921,547	242,801,416
資産合計	37,921,547	242,801,416
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,250	6,433,954
未払受託者報酬	5,018	33,368
未払委託者報酬	45,133	268,065
未払利息	-	5
その他未払費用	569	4,118
流動負債合計	60,970	6,739,510
負債合計	60,970	6,739,510
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	28,842,973	171,309,984
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,017,604	64,751,922
(分配準備積立金)	1,890,154	8,213,486
元本等合計	37,860,577	236,061,906
純資産合計	37,860,577	236,061,906
負債純資産合計	37,921,547	242,801,416

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自 至	2020年 8月29日 2021年 8月30日	自 至	2021年 8月31日 2022年 8月29日
営業収益				
受取配当金		-		3,273
受取利息		-		9
有価証券売買等損益		2,390,348		8,070,622
営業収益合計		2,390,348		8,073,904
営業費用				
支払利息		45		372
受託者報酬		6,579		46,943
委託者報酬		59,022		390,173
その他費用		713		5,757
営業費用合計		66,359		443,245
営業利益又は営業損失（ ）		2,323,989		7,630,659
経常利益又は経常損失（ ）		2,323,989		7,630,659
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,323,989		7,630,659
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（ ）		582,808		626,828
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		229,542		9,017,604
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,444,425		58,862,038
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,444,425		58,862,038
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,397,544		10,131,551
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,397,544		10,131,551
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,017,604		64,751,922

## (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)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8月29日から翌年8月28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 8月31日から2022年 8月29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 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	28,842,973口	171,309,984口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3126円 (13,126円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3780円 (13,780円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日			第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	310,750円	費用控除後の配当等収益額	A	2,576,495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	1,430,431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	4,427,336円
収益調整金額	C	7,127,450円	収益調整金額	C	56,538,436円

第3期 自 2020年 8月29日 至 2021年 8月30日			第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日		
分配準備積立金額	D	148,973円	分配準備積立金額	D	1,209,655円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,017,604円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	64,751,922円
当ファンドの期末残存口数	F	28,842,973口	当ファンドの期末残存口数	F	171,309,984口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,126円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,779円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29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 8月29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



	第4期 (2022年 8月29日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （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 8月29日 至 2021年 8月30日	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,746,642円	28,842,973円
期中追加設定元本額	33,572,862円	173,520,838円
期中一部解約元本額	7,476,531円	31,053,827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 8月30日現在)	第4期 (2022年 8月29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	629	-
親投資信託受益証券	2,053,902	7,499,251
合計	2,054,531	7,499,251

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	13,561,919	49,774,955	
	国内株式インデックス マザーファンド	8,307,058	15,971,149	
	外国株式インデックス マザーファンド	21,859,038	96,112,004	
	国内債券インデックス マザーファンド	3,762,691	5,166,174	
	外国債券インデックス マザーファンド	13,104,542	41,323,862	
	新興国債券インデックス マザーファンド	11,692,657	21,140,323	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	4,707,356	4,234,266	
合計		76,995,261	233,722,733	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 8月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2022年 8月29日現在
項目	金額（円）
流動資産	
コール・ローン	1,968,362,808
株式	504,544,593,870
派生商品評価勘定	18,831,400
未収入金	398,650
未収配当金	636,990,689
前払金	9,282,800
差入委託証拠金	62,800,800
流動資産合計	507,241,261,017
資産合計	507,241,261,017
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	28,147,750
未払解約金	89,708,778
未払利息	3,293
流動負債合計	117,859,821
負債合計	117,859,821
純資産の部	
元本等	
元本	263,768,603,358
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	243,354,797,838
元本等合計	507,123,401,196
純資産合計	507,123,401,196
負債純資産合計	507,241,261,017

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 8月29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 8月29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 8月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	263,768,603,358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 1.9226円 (1万口当たり純資産額) (19,226円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2022年 8月29日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月29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 8月29日現在
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2022年 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	253,126,744,568円
期中追加設定元本額	33,799,390,866円
期中一部解約元本額	23,157,532,076円
期末元本額	263,768,603,358円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	394,339,020円

区分	2022年 8月29日現在
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,025,214,487円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,568,865円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,680,332,872円
世界経済インデックスファンド	4,102,699,556円
日本株式インデックス・オープン	3,268,391,160円
D C マイセレクション 2 5	6,232,427,921円
D C マイセレクション 5 0	19,062,711,002円
D C マイセレクション 7 5	19,050,637,723円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,191,232,095円
D C マイセレクション S 2 5	3,184,547,513円
D C マイセレクション S 5 0	9,374,379,052円
D C マイセレクション S 7 5	7,200,602,171円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,456,620,031円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	161,071,852円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	680,805,366円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	506,555,925円
D C 世界経済インデックスファンド	3,703,031,059円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,631,480,254円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	4,129,572円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	19,221,125円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	21,109,086円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	171,157,244円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	27,817,384円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	109,223,677円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	25,432,978円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	70,429,312円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	858,057,336円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	428,697,945円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	2,770,110,736円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	45,623,436円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	17,757,243円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	468,175,602円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	266,883,921円
バランス F（25）V A 1（適格機関投資家専用）	342,354,978円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	34,791,727円
F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	585,372,988円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	3,322,989,958円
日本株式ファンド・シリーズ 2	1,898,240,555円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,965,998,216円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,319,372,568円
分散投資コア戦略ファンド A	1,440,100,504円
分散投資コア戦略ファンド S	6,097,040,794円

区分	2022年 8月29日現在
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	497,548,571円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	434,571,418円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,880,527,274円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	221,967,257円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,959,453円
S M T インデックスバランス・オープン	58,229,110円
国内株式S M T Bセレクション(S M A専用)	31,582,895,984円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	550,582,732円
S M T 世界経済インデックス・オープン	49,847,257円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	189,515,266円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	33,778,301円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	9,187,174円
グローバル経済コア	223,170,690円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	28,835,318円
M y S M T T O P I Xインデックス(ノーロード)	154,260,657円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	24,202,861円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,309,165,117円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	224,714,875円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	18,069,483円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	15,014,672円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	5,748,222円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	8,307,058円
10資産分散投資ファンド	32,436円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	44,571,522,793円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	894,108,933円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	316,197,368円
F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	53,623,641円
S M T A M 9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	226,775,993円
S M T A M 日本株式インデックスファンドV L - P(適格機関投資家専用)	45,728,188,890円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	15,940,173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)	197,097,200円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年 8月29日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	5,744,022,294
合計	5,744,022,294

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2022年 8月29日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,537,132,800	-	2,527,850,000	9,282,800
合計		2,537,132,800	-	2,527,850,000	9,282,800

## （注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	8,900	3,700.00	32,930,000	
日本水産	255,800	570.00	145,806,000	
マルハニチロ	36,500	2,492.00	90,958,000	
雪国まいたけ	20,100	1,033.00	20,763,300	
カネコ種苗	7,800	1,591.00	12,409,800	
サカタのタネ	29,900	4,965.00	148,453,500	
ホクト	21,000	1,929.00	40,509,000	
ホクリヨウ	3,700	614.00	2,271,800	
住石ホールディングス	48,200	242.00	11,664,400	
日鉄鉱業	5,300	6,050.00	32,065,000	
三井松島ホールディングス	11,500	3,680.00	42,320,000	
I N P E X	873,500	1,594.00	1,392,359,000	
石油資源開発	32,400	3,920.00	127,008,000	
K & Oエナジーグループ	10,700	1,604.00	17,162,800	
ショーボンドホールディングス	32,200	6,020.00	193,844,000	
ミライト・ワン	88,700	1,588.00	140,855,600	
タマホーム	16,700	2,397.00	40,029,900	
サンヨーホームズ	3,200	701.00	2,243,200	
日本アクア	10,900	637.00	6,943,300	



ファーストコーポレーション	6,700	742.00	4,971,400
ベストテラ	5,600	1,125.00	6,300,000
Robot Home	40,200	193.00	7,758,600
キャンディル	4,100	580.00	2,378,000
ダイセキ環境ソリューション	5,300	916.00	4,854,800
第一カッター興業	6,000	1,291.00	7,746,000
安藤・間	125,400	875.00	109,725,000
東急建設	74,000	663.00	49,062,000
コムシスホールディングス	88,800	2,596.00	230,524,800
ピーアールホールディングス	34,600	351.00	12,144,600
高松コンストラクショングループ	17,500	1,924.00	33,670,000
東建コーポレーション	7,600	8,970.00	68,172,000
ソネック	2,800	1,029.00	2,881,200
ヤマウラ	12,000	956.00	11,472,000
オリエンタル白石	92,600	256.00	23,705,600
大成建設	177,100	4,110.00	727,881,000
大林組	590,800	961.00	567,758,800
清水建設	546,400	769.00	420,181,600
飛鳥建設	17,000	1,087.00	18,479,000
長谷工コーポレーション	170,500	1,586.00	270,413,000
松井建設	21,200	602.00	12,762,400
銭高組	2,300	3,370.00	7,751,000
鹿島建設	432,900	1,478.00	639,826,200
不動テトラ	13,500	1,573.00	21,235,500
大末建設	6,700	1,507.00	10,096,900
鉄建建設	12,800	1,786.00	22,860,800
西松建設	38,500	4,030.00	155,155,000
三井住友建設	143,500	463.00	66,440,500
大豊建設	9,300	4,115.00	38,269,500
佐田建設	13,700	438.00	6,000,600
ナカノフドー建設	15,200	300.00	4,560,000
奥村組	31,700	2,970.00	94,149,000
東鉄工業	25,000	2,313.00	57,825,000
イチケン	4,600	1,815.00	8,349,000
富士ピー・エス	8,200	459.00	3,763,800
浅沼組	14,200	2,842.00	40,356,400
戸田建設	243,900	683.00	166,583,700
熊谷組	31,500	2,675.00	84,262,500
北野建設	3,900	2,080.00	8,112,000
植木組	5,200	1,310.00	6,812,000
矢作建設工業	25,300	767.00	19,405,100
ピーエス三菱	20,900	653.00	13,647,700

日本ハウスホールディングス	32,800	423.00	13,874,400	
大東建託	65,100	13,590.00	884,709,000	
新日本建設	27,100	728.00	19,728,800	
東亜道路工業	3,300	5,930.00	19,569,000	
日本道路	5,500	6,200.00	34,100,000	
東亜建設工業	14,200	2,441.00	34,662,200	
日本国土開発	49,500	605.00	29,947,500	
若築建設	9,800	2,507.00	24,568,600	
東洋建設	71,300	863.00	61,531,900	
五洋建設	234,200	733.00	171,668,600	
世紀東急工業	29,000	759.00	22,011,000	
福田組	6,200	4,960.00	30,752,000	
住友林業	126,700	2,368.00	300,025,600	
日本基礎技術	15,500	532.00	8,246,000	
巴コーポレーション	23,100	442.00	10,210,200	
大和ハウス工業	503,600	3,144.00	1,583,318,400	
ライト工業	35,000	1,866.00	65,310,000	
積水ハウス	603,800	2,357.00	1,423,156,600	
日特建設	13,100	906.00	11,868,600	
北陸電気工事	11,300	762.00	8,610,600	
ユアテック	36,400	748.00	27,227,200	
日本リーテック	12,100	846.00	10,236,600	
四電工	6,100	1,879.00	11,461,900	
中電工	25,600	2,138.00	54,732,800	
関電工	103,500	844.00	87,354,000	
きんでん	129,200	1,490.00	192,508,000	
東京エネシス	18,800	1,064.00	20,003,200	
トーエネック	6,400	3,665.00	23,456,000	
住友電設	15,700	2,638.00	41,416,600	
日本電設工業	27,100	1,748.00	47,370,800	
エクシオグループ	88,300	2,145.00	189,403,500	
新日本空調	13,800	1,864.00	25,723,200	
九電工	40,200	2,827.00	113,645,400	
三機工業	41,300	1,637.00	67,608,100	
日揮ホールディングス	179,700	1,887.00	339,093,900	
中外炉工業	5,900	1,658.00	9,782,200	
ヤマト	15,300	773.00	11,826,900	
太平電業	11,500	3,605.00	41,457,500	
高砂熱学工業	48,700	1,649.00	80,306,300	
三晃金属工業	2,500	2,659.00	6,647,500	
朝日工業社	7,700	1,933.00	14,884,100	
明星工業	32,000	745.00	23,840,000	

大気社	26,500	3,200.00	84,800,000
ダイダン	11,900	2,229.00	26,525,100
日比谷総合設備	17,300	1,859.00	32,160,700
フィル・カンパニー	2,900	1,243.00	3,604,700
テスホールディングス	17,800	1,204.00	21,431,200
インフロニア・ホールディングス	221,500	996.00	220,614,000
東洋エンジニアリング	26,700	709.00	18,930,300
レイズネクスト	27,300	1,226.00	33,469,800
ニッポン	49,700	1,578.00	78,426,600
日清製粉グループ本社	191,700	1,591.00	304,994,700
日東富士製粉	3,000	4,740.00	14,220,000
昭和産業	16,100	2,592.00	41,731,200
鳥越製粉	14,800	663.00	9,812,400
中部飼料	21,000	1,076.00	22,596,000
フィード・ワン	24,200	705.00	17,061,000
東洋精糖	3,400	902.00	3,066,800
日本甜菜製糖	10,600	1,632.00	17,299,200
D M三井製糖ホールディングス	16,400	1,872.00	30,700,800
塩水港精糖	24,300	204.00	4,957,200
日新製糖	9,600	1,752.00	16,819,200
森永製菓	41,000	4,020.00	164,820,000
中村屋	4,100	3,120.00	12,792,000
江崎グリコ	47,400	3,645.00	172,773,000
名糖産業	7,300	1,666.00	12,161,800
井村屋グループ	9,900	2,242.00	22,195,800
不二家	11,400	2,358.00	26,881,200
山崎製パン	111,000	1,634.00	181,374,000
第一屋製パン	3,500	476.00	1,666,000
モロゾフ	6,000	3,720.00	22,320,000
亀田製菓	10,500	4,535.00	47,617,500
寿スピリッツ	17,600	7,810.00	137,456,000
カルビー	92,800	2,750.00	255,200,000
森永乳業	34,500	4,330.00	149,385,000
六甲バター	12,200	1,452.00	17,714,400
ヤクルト本社	129,300	8,120.00	1,049,916,000
明治ホールディングス	112,200	6,610.00	741,642,000
雪印メグミルク	44,600	1,729.00	77,113,400
プリマハム	25,500	2,185.00	55,717,500
日本ハム	71,300	3,995.00	284,843,500
林兼産業	6,200	472.00	2,926,400
丸大食品	18,400	1,568.00	28,851,200
S Foods	18,300	2,998.00	54,863,400

柿安本店	7,100	2,294.00	16,287,400
伊藤ハム米久ホールディングス	128,900	675.00	87,007,500
サッポロホールディングス	54,600	3,035.00	165,711,000
アサヒグループホールディングス	383,200	4,680.00	1,793,376,000
キリンホールディングス	748,500	2,250.00	1,684,125,000
宝ホールディングス	113,200	1,063.00	120,331,600
オエノンホールディングス	49,600	289.00	14,334,400
養命酒製造	5,500	1,832.00	10,076,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,900	1,440.00	187,056,000
サントリー食品インターナショナル	116,800	5,120.00	598,016,000
ダイドーグループホールディングス	10,400	4,720.00	49,088,000
伊藤園	61,800	6,150.00	380,070,000
キーコーヒー	18,600	2,158.00	40,138,800
ユニカフェ	6,100	923.00	5,630,300
ジャパンフーズ	2,900	1,115.00	3,233,500
日清オイリオグループ	23,400	3,295.00	77,103,000
不二製油グループ本社	44,100	2,373.00	104,649,300
かどや製油	1,800	3,585.00	6,453,000
J - オイルミルズ	19,000	1,615.00	30,685,000
キッコーマン	122,100	8,580.00	1,047,618,000
味の素	405,900	3,762.00	1,526,995,800
ブルドックソース	7,300	1,854.00	13,534,200
キューピー	89,100	2,279.00	203,058,900
ハウス食品グループ本社	63,500	2,952.00	187,452,000
カゴメ	77,300	3,090.00	238,857,000
焼津水産化学工業	8,200	871.00	7,142,200
アリアケジャパン	18,600	4,785.00	89,001,000
ピエトロ	2,700	1,784.00	4,816,800
エバラ食品工業	4,500	3,170.00	14,265,000
やまみ	1,800	1,449.00	2,608,200
ニチレイ	76,000	2,469.00	187,644,000
東洋水産	90,800	5,650.00	513,020,000
イトアンドホールディングス	7,700	2,221.00	17,101,700
大冷	2,300	1,904.00	4,379,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,500	506.00	5,313,000
日清食品ホールディングス	65,700	10,040.00	659,628,000
永谷園ホールディングス	9,000	2,016.00	18,144,000
一正蒲鉾	7,900	793.00	6,264,700
フジッコ	18,900	1,930.00	36,477,000
ロック・フィールド	20,200	1,559.00	31,491,800
日本たばこ産業	1,091,900	2,364.00	2,581,251,600
ケンコーマヨネーズ	10,400	1,508.00	15,683,200

わらべや日洋ホールディングス	12,200	2,272.00	27,718,400
なとり	11,400	2,061.00	23,495,400
イフジ産業	3,500	920.00	3,220,000
ピクルスコーポレーション	9,700	1,177.00	11,416,900
ファーマフーズ	25,600	1,455.00	37,248,000
ユーグレナ	106,800	1,000.00	106,800,000
紀文食品	15,800	997.00	15,752,600
ミヨシ油脂	6,500	1,000.00	6,500,000
理研ビタミン	14,300	1,733.00	24,781,900
片倉工業	15,800	2,027.00	32,026,600
ゲンゼ	11,700	3,890.00	45,513,000
東洋紡	79,100	1,041.00	82,343,100
ユニチカ	57,000	257.00	14,649,000
富士紡ホールディングス	8,300	3,565.00	29,589,500
倉敷紡績	14,100	2,109.00	29,736,900
シキボウ	10,400	902.00	9,380,800
日本毛織	49,600	1,021.00	50,641,600
トーア紡コーポレーション	7,300	363.00	2,649,900
帝国繊維	19,400	1,621.00	31,447,400
帝人	175,000	1,475.00	258,125,000
東レ	1,234,000	791.40	976,587,600
住江織物	3,400	1,738.00	5,909,200
日本フェルト	12,600	416.00	5,241,600
イチカワ	2,800	1,392.00	3,897,600
日東製網	2,100	1,359.00	2,853,900
アツギ	14,700	418.00	6,144,600
ダイニック	6,400	626.00	4,006,400
セーレン	36,900	2,110.00	77,859,000
ソトー	7,500	779.00	5,842,500
東海染工	2,500	1,128.00	2,820,000
小松マテーレ	30,100	923.00	27,782,300
ワコールホールディングス	40,700	2,207.00	89,824,900
ホギメディカル	24,800	3,495.00	86,676,000
T S Iホールディングス	60,900	379.00	23,081,100
マツオカコーポレーション	6,000	949.00	5,694,000
ワールド	26,200	1,338.00	35,055,600
三陽商会	8,700	916.00	7,969,200
ナイガイ	7,600	263.00	1,998,800
オンワードホールディングス	110,300	263.00	29,008,900
ルックホールディングス	5,500	1,946.00	10,703,000
ゴールドウイン	32,900	8,330.00	274,057,000
デサント	34,000	3,435.00	116,790,000

キング	9,800	449.00	4,400,200
ヤマトインターナショナル	15,600	284.00	4,430,400
特種東海製紙	10,300	3,220.00	33,166,000
王子ホールディングス	766,800	559.00	428,641,200
日本製紙	80,600	911.00	73,426,600
三菱製紙	25,400	299.00	7,594,600
北越コーポレーション	118,500	757.00	89,704,500
中越パルプ工業	7,600	1,003.00	7,622,800
巴川製紙所	5,900	816.00	4,814,400
大王製紙	85,200	1,321.00	112,549,200
阿波製紙	4,500	302.00	1,359,000
レンゴー	153,700	817.00	125,572,900
トーモク	9,700	1,512.00	14,666,400
ザ・パック	12,500	2,300.00	28,750,000
北の達人コーポレーション	71,100	224.00	15,926,400
クラレ	268,200	1,066.00	285,901,200
旭化成	1,229,300	1,020.00	1,253,886,000
共和レザー	10,800	557.00	6,015,600
昭和電工	163,100	2,176.00	354,905,600
住友化学	1,355,600	552.00	748,291,200
住友精化	7,900	3,110.00	24,569,000
日産化学	89,400	7,080.00	632,952,000
ラサ工業	7,000	2,390.00	16,730,000
クレハ	14,400	9,680.00	139,392,000
多木化学	6,600	5,070.00	33,462,000
テイカ	11,300	1,250.00	14,125,000
石原産業	35,600	1,078.00	38,376,800
片倉コープアグリ	4,500	1,275.00	5,737,500
日本曹達	21,800	4,560.00	99,408,000
東ソー	245,700	1,800.00	442,260,000
トクヤマ	59,000	1,837.00	108,383,000
セントラル硝子	29,800	3,355.00	99,979,000
東亜合成	86,800	1,102.00	95,653,600
大阪ソーダ	15,200	3,750.00	57,000,000
関東電化工業	36,200	984.00	35,620,800
デンカ	66,900	3,325.00	222,442,500
信越化学工業	315,000	16,435.00	5,177,025,000
日本カーバイド工業	7,100	1,248.00	8,860,800
堺化学工業	12,900	1,955.00	25,219,500
第一稀元素化学工業	16,900	1,356.00	22,916,400
エア・ウォーター	159,200	1,740.00	277,008,000
日本酸素ホールディングス	163,700	2,484.00	406,630,800

日本化学工業	5,600	2,123.00	11,888,800
東邦アセチレン	4,000	1,173.00	4,692,000
日本パーカライジング	83,500	960.00	80,160,000
高压ガス工業	28,000	674.00	18,872,000
チタン工業	2,300	1,643.00	3,778,900
四国化成工業	23,000	1,252.00	28,796,000
戸田工業	4,200	2,598.00	10,911,600
ステラ ケミファ	10,000	2,809.00	28,090,000
保土谷化学工業	5,300	3,265.00	17,304,500
日本触媒	28,300	5,580.00	157,914,000
大日精化工業	14,100	1,790.00	25,239,000
カネカ	42,800	3,660.00	156,648,000
三菱瓦斯化学	156,400	2,052.00	320,932,800
三井化学	154,700	3,140.00	485,758,000
J S R	185,200	3,125.00	578,750,000
東京応化工業	29,500	6,910.00	203,845,000
大阪有機化学工業	12,700	2,567.00	32,600,900
三菱ケミカルグループ	1,233,500	731.80	902,675,300
K Hネオケム	28,100	2,540.00	71,374,000
ダイセル	267,200	881.00	235,403,200
住友ベークライト	28,100	4,375.00	122,937,500
積水化学工業	379,600	1,889.00	717,064,400
日本ゼオン	149,300	1,337.00	199,614,100
アイカ工業	46,800	3,085.00	144,378,000
U B E	93,700	2,051.00	192,178,700
積水樹脂	27,300	1,712.00	46,737,600
タキロンシーアイ	43,000	539.00	23,177,000
旭有機材	11,200	2,301.00	25,771,200
ニチバン	10,500	1,610.00	16,905,000
リケンテクノス	40,400	523.00	21,129,200
大倉工業	7,800	1,853.00	14,453,400
積水化成品工業	23,700	408.00	9,669,600
群栄化学工業	4,000	2,492.00	9,968,000
タイガースポリマー	9,500	424.00	4,028,000
ミライアル	6,400	1,916.00	12,262,400
ダイキアクシス	6,900	681.00	4,698,900
ダイキョーニシカワ	41,900	580.00	24,302,000
竹本容器	6,300	751.00	4,731,300
森六ホールディングス	9,600	1,784.00	17,126,400
恵和	5,500	4,120.00	22,660,000
日本化薬	139,600	1,226.00	171,149,600
カーリットホールディングス	16,700	677.00	11,305,900

日本精化	12,800	1,950.00	24,960,000
扶桑化学工業	15,700	3,445.00	54,086,500
トリケミカル研究所	20,500	2,397.00	49,138,500
A D E K A	78,400	2,344.00	183,769,600
日油	57,400	5,320.00	305,368,000
新日本理化	28,200	247.00	6,965,400
ハリマ化成グループ	13,100	904.00	11,842,400
花王	418,900	6,076.00	2,545,236,400
第一工業製薬	6,700	2,219.00	14,867,300
石原ケミカル	9,200	1,330.00	12,236,000
日華化学	7,500	844.00	6,330,000
ニイタカ	3,700	2,380.00	8,806,000
三洋化成工業	11,900	4,715.00	56,108,500
有機合成薬品工業	13,800	326.00	4,498,800
大日本塗料	22,500	747.00	16,807,500
日本ペイントホールディングス	746,600	1,048.00	782,436,800
関西ペイント	171,700	2,101.00	360,741,700
神東塗料	15,600	145.00	2,262,000
中国塗料	43,000	877.00	37,711,000
日本特殊塗料	11,900	950.00	11,305,000
藤倉化成	24,700	477.00	11,781,900
太陽ホールディングス	29,300	2,751.00	80,604,300
D I C	65,900	2,507.00	165,211,300
サカタインクス	37,500	963.00	36,112,500
東洋インキSCホールディングス	33,000	1,906.00	62,898,000
T & K T O K A	16,100	988.00	15,906,800
富士フイルムホールディングス	356,600	7,114.00	2,536,852,400
資生堂	352,800	5,316.00	1,875,484,800
ライオン	202,700	1,624.00	329,184,800
高砂香料工業	11,400	2,859.00	32,592,600
マンダム	39,500	1,512.00	59,724,000
ミルボン	25,000	5,850.00	146,250,000
ファンケル	82,100	2,796.00	229,551,600
コーセー	34,400	13,430.00	461,992,000
コタ	14,100	1,581.00	22,292,100
シーボン	2,600	1,679.00	4,365,400
ポーラ・オルビスホールディングス	86,600	1,557.00	134,836,200
ノエビアホールディングス	15,100	5,830.00	88,033,000
アジュバンホールディングス	4,600	966.00	4,443,600
新日本製薬	9,600	1,644.00	15,782,400
エステー	13,000	1,541.00	20,033,000
アグロ カネショウ	6,800	1,356.00	9,220,800



コニシ	30,800	1,627.00	50,111,600
長谷川香料	35,000	2,999.00	104,965,000
星光P M C	9,500	590.00	5,605,000
小林製薬	51,700	8,020.00	414,634,000
荒川化学工業	14,300	1,036.00	14,814,800
メック	13,900	2,455.00	34,124,500
日本高純度化学	4,800	2,394.00	11,491,200
タカラバイオ	53,100	1,946.00	103,332,600
J C U	20,800	3,335.00	69,368,000
新田ゼラチン	11,600	798.00	9,256,800
O A T アグリオ	7,700	1,993.00	15,346,100
デクセリアルズ	52,800	3,835.00	202,488,000
アース製薬	15,300	5,470.00	83,691,000
北興化学工業	17,000	1,074.00	18,258,000
大成ラミック	5,300	2,813.00	14,908,900
クミアイ化学工業	67,100	1,059.00	71,058,900
日本農薬	36,100	837.00	30,215,700
アキレス	13,000	1,366.00	17,758,000
有沢製作所	27,600	1,308.00	36,100,800
日東電工	122,600	8,560.00	1,049,456,000
レック	24,000	763.00	18,312,000
三光合成	23,200	456.00	10,579,200
きもと	31,100	252.00	7,837,200
藤森工業	15,800	3,510.00	55,458,000
前澤化成工業	11,900	1,319.00	15,696,100
未来工業	7,300	1,511.00	11,030,300
ウェーブロックホールディングス	7,700	638.00	4,912,600
J S P	11,900	1,450.00	17,255,000
エフピコ	37,300	3,295.00	122,903,500
天馬	15,900	2,251.00	35,790,900
信越ポリマー	36,400	1,338.00	48,703,200
東リ	46,300	205.00	9,491,500
ニフコ	67,700	3,120.00	211,224,000
バルカー	16,500	2,707.00	44,665,500
ユニ・チャーム	352,000	4,855.00	1,708,960,000
ショーエイコーポレーション	5,400	582.00	3,142,800
協和キリン	204,100	3,065.00	625,566,500
武田薬品工業	1,594,700	3,821.00	6,093,348,700
アステラス製薬	1,734,700	1,973.00	3,422,563,100
住友ファーマ	125,300	1,043.00	130,687,900
塩野義製薬	235,500	6,753.00	1,590,331,500
わかもと製薬	19,800	240.00	4,752,000

日本新薬	44,300	7,460.00	330,478,000
中外製薬	528,800	3,642.00	1,925,889,600
科研製薬	28,900	3,845.00	111,120,500
エーザイ	224,200	5,643.00	1,265,160,600
ロート製薬	96,700	4,115.00	397,920,500
小野薬品工業	391,100	3,313.00	1,295,714,300
久光製薬	42,900	3,395.00	145,645,500
持田製薬	22,800	3,370.00	76,836,000
参天製薬	353,400	1,002.00	354,106,800
扶桑薬品工業	6,500	2,121.00	13,786,500
日本ケミファ	2,100	1,901.00	3,992,100
ツムラ	58,000	3,145.00	182,410,000
日医工	57,200	352.00	20,134,400
キッセイ薬品工業	29,400	2,407.00	70,765,800
生化学工業	35,800	871.00	31,181,800
栄研化学	30,200	1,856.00	56,051,200
鳥居薬品	9,100	2,960.00	26,936,000
JCRファーマ	57,200	2,130.00	121,836,000
東和薬品	29,200	2,219.00	64,794,800
富士製薬工業	10,900	1,014.00	11,052,600
ゼリア新薬工業	30,100	2,098.00	63,149,800
第一三共	1,471,800	4,108.00	6,046,154,400
キョーリン製薬ホールディングス	36,600	1,758.00	64,342,800
大幸薬品	30,600	617.00	18,880,200
ダイト	12,700	2,606.00	33,096,200
大塚ホールディングス	386,500	4,550.00	1,758,575,000
大正製薬ホールディングス	37,500	5,180.00	194,250,000
ペプチドリーム	81,900	1,637.00	134,070,300
あすか製薬ホールディングス	19,300	1,193.00	23,024,900
サワイグループホールディングス	38,900	4,150.00	161,435,000
日本コークス工業	171,400	101.00	17,311,400
ニチレキ	22,000	1,371.00	30,162,000
ユシロ化学工業	9,600	885.00	8,496,000
ビーピー・カストロール	7,200	1,102.00	7,934,400
富士石油	44,300	371.00	16,435,300
MORESCO	6,700	1,188.00	7,959,600
出光興産	206,400	3,690.00	761,616,000
ENEOSホールディングス	3,052,200	525.90	1,605,151,980
コスモエネルギーホールディングス	80,100	4,145.00	332,014,500
横浜ゴム	96,100	2,271.00	218,243,100
TOYO TIRE	97,100	1,670.00	162,157,000
ブリヂストン	539,500	5,380.00	2,902,510,000

住友ゴム工業	165,700	1,175.00	194,697,500
藤倉コンポジット	16,200	1,058.00	17,139,600
オカモト	9,400	3,930.00	36,942,000
フコク	8,900	1,014.00	9,024,600
ニッタ	19,100	2,926.00	55,886,600
住友理工	39,300	577.00	22,676,100
三ツ星ベルト	24,600	3,200.00	78,720,000
バンドー化学	32,700	987.00	32,274,900
日東紡績	25,200	2,525.00	63,630,000
A G C	171,900	4,745.00	815,665,500
日本板硝子	91,700	516.00	47,317,200
石塚硝子	3,300	1,636.00	5,398,800
日本山村硝子	7,200	651.00	4,687,200
日本電気硝子	69,000	2,617.00	180,573,000
オハラ	8,100	1,326.00	10,740,600
住友大阪セメント	30,300	3,380.00	102,414,000
太平洋セメント	115,300	2,028.00	233,828,400
日本ヒューム	16,800	692.00	11,625,600
日本コンクリート工業	36,900	269.00	9,926,100
三谷セキサン	8,300	3,545.00	29,423,500
アジアパイルホールディングス	29,100	507.00	14,753,700
東海カーボン	141,800	1,024.00	145,203,200
日本カーボン	9,700	4,095.00	39,721,500
東洋炭素	10,600	3,280.00	34,768,000
ノリタケカンパニーリミテド	10,300	4,160.00	42,848,000
T O T O	122,700	4,760.00	584,052,000
日本碍子	199,900	1,940.00	387,806,000
日本特殊陶業	141,500	2,855.00	403,982,500
M A R U W A	7,000	17,190.00	120,330,000
品川リフラクトリーズ	4,800	3,760.00	18,048,000
黒崎播磨	3,500	4,755.00	16,642,500
ヨータイ	13,000	1,395.00	18,135,000
東京窯業	20,500	275.00	5,637,500
ニッカトー	8,700	467.00	4,062,900
フジインコーポレーテッド	16,300	6,690.00	109,047,000
クニミネ工業	6,500	848.00	5,512,000
エーアンドエーマテリアル	3,600	864.00	3,110,400
ニチアス	42,800	2,367.00	101,307,600
ニチハ	25,900	2,695.00	69,800,500
日本製鉄	838,100	2,182.00	1,828,734,200
神戸製鋼所	349,600	631.00	220,597,600
中山製鋼所	27,900	548.00	15,289,200

合同製鐵	9,800	1,787.00	17,512,600
J F E ホールディングス	464,500	1,498.00	695,821,000
東京製鐵	58,700	1,422.00	83,471,400
共英製鋼	19,800	1,509.00	29,878,200
大和工業	32,800	4,925.00	161,540,000
東京鐵鋼	8,300	1,347.00	11,180,100
大阪製鐵	10,700	1,284.00	13,738,800
淀川製鋼所	22,000	2,431.00	53,482,000
丸一鋼管	58,200	2,960.00	172,272,000
モリ工業	4,900	2,748.00	13,465,200
大同特殊鋼	27,400	3,890.00	106,586,000
日本高周波鋼業	7,600	324.00	2,462,400
日本冶金工業	13,700	2,908.00	39,839,600
山陽特殊製鋼	17,200	2,080.00	35,776,000
愛知製鋼	11,300	2,101.00	23,741,300
日立金属	216,200	2,116.00	457,479,200
日本金属	5,100	1,079.00	5,502,900
大平洋金属	12,400	2,470.00	30,628,000
新日本電工	111,300	374.00	41,626,200
栗本鐵工所	8,300	1,652.00	13,711,600
虹技	2,600	954.00	2,480,400
三菱製鋼	12,900	1,030.00	13,287,000
日亜鋼業	23,100	252.00	5,821,200
日本精線	3,200	4,625.00	14,800,000
エンビプロ・ホールディングス	13,400	996.00	13,346,400
シンニッタン	24,600	222.00	5,461,200
新家工業	4,200	1,762.00	7,400,400
大紀アルミニウム工業所	24,800	1,340.00	33,232,000
日本軽金属ホールディングス	50,800	1,610.00	81,788,000
三井金属鉱業	54,200	3,260.00	176,692,000
東邦亜鉛	10,300	2,401.00	24,730,300
三菱マテリアル	116,000	2,096.00	243,136,000
住友金属鉱山	219,900	4,387.00	964,701,300
D O W A ホールディングス	46,900	5,210.00	244,349,000
古河機械金属	30,700	1,256.00	38,559,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,200	3,150.00	73,080,000
東邦チタニウム	36,000	2,218.00	79,848,000
U A C J	27,400	2,445.00	66,993,000
C K サンエツ	3,800	4,100.00	15,580,000
古河電気工業	57,900	2,425.00	140,407,500
住友電気工業	700,200	1,604.00	1,123,120,800
フジクラ	223,800	989.00	221,338,200

昭和電線ホールディングス	17,500	1,829.00	32,007,500
東京特殊電線	2,600	2,240.00	5,824,000
タツタ電線	35,600	465.00	16,554,000
カナレ電気	3,100	1,519.00	4,708,900
平河ヒューテック	11,200	1,139.00	12,756,800
リョービ	18,600	1,299.00	24,161,400
アーレスティ	21,600	424.00	9,158,400
アサヒホールディングス	80,400	2,068.00	166,267,200
稲葉製作所	10,200	1,319.00	13,453,800
宮地エンジニアリンググループ	5,700	3,210.00	18,297,000
トーカロ	51,800	1,272.00	65,889,600
アルファC o	7,100	960.00	6,816,000
SUMCO	330,900	1,915.00	633,673,500
川田テクノロジーズ	3,700	3,690.00	13,653,000
RS Technologies	5,700	6,940.00	39,558,000
ジェイテックコーポレーション	2,600	1,779.00	4,625,400
信和	12,400	812.00	10,068,800
東洋製罐グループホールディングス	102,200	1,624.00	165,972,800
ホッカンホールディングス	9,300	1,326.00	12,331,800
コロナ	9,700	835.00	8,099,500
横河ブリッジホールディングス	28,700	1,913.00	54,903,100
駒井ハルテック	3,100	1,680.00	5,208,000
高田機工	1,700	2,423.00	4,119,100
三和ホールディングス	189,200	1,380.00	261,096,000
文化シャッター	59,100	1,066.00	63,000,600
三協立山	23,900	614.00	14,674,600
アルインコ	13,300	898.00	11,943,400
東洋シャッター	4,400	544.00	2,393,600
LIXIL	315,800	2,470.00	780,026,000
日本フィルコン	12,600	485.00	6,111,000
ノーリツ	25,600	1,532.00	39,219,200
長府製作所	18,100	1,965.00	35,566,500
リンナイ	34,700	10,500.00	364,350,000
ダイニチ工業	9,600	641.00	6,153,600
日東精工	25,200	540.00	13,608,000
三洋工業	2,400	1,669.00	4,005,600
岡部	27,900	653.00	18,218,700
ジーテクト	22,100	1,404.00	31,028,400
東プレ	30,600	1,220.00	37,332,000
高周波熱錬	30,900	677.00	20,919,300
東京製綱	12,300	1,004.00	12,349,200
サンコール	17,200	708.00	12,177,600

モリテック スチール	15,600	292.00	4,555,200	
パイオラックス	26,400	2,001.00	52,826,400	
エイチワン	17,900	608.00	10,883,200	
日本発條	169,100	938.00	158,615,800	
中央発條	9,700	712.00	6,906,400	
アドバネクス	2,600	1,228.00	3,192,800	
立川ブラインド工業	7,800	1,048.00	8,174,400	
三益半導体工業	15,700	2,151.00	33,770,700	
日本ドライケミカル	4,600	1,633.00	7,511,800	
日本製鋼所	51,600	3,095.00	159,702,000	
三浦工業	79,000	2,962.00	233,998,000	
タクマ	57,700	1,409.00	81,299,300	
ツガミ	41,200	1,240.00	51,088,000	
オークマ	19,200	5,100.00	97,920,000	
芝浦機械	22,700	3,035.00	68,894,500	
アマダ	316,900	1,071.00	339,399,900	
アイダエンジニアリング	44,000	867.00	38,148,000	
滝澤鉄工所	5,900	1,172.00	6,914,800	
F U J I	80,200	2,007.00	160,961,400	
牧野フライス製作所	20,400	4,305.00	87,822,000	
オーエスジー	81,400	1,919.00	156,206,600	
ダイジェット工業	2,400	902.00	2,164,800	
旭ダイヤモンド工業	49,400	795.00	39,273,000	
D M G 森精機	103,300	1,770.00	182,841,000	
ソディック	47,500	804.00	38,190,000	
ディスコ	29,600	33,850.00	1,001,960,000	
日東工器	9,700	1,627.00	15,781,900	
日進工具	15,900	1,120.00	17,808,000	
パンチ工業	17,300	438.00	7,577,400	
富士ダイス	10,300	629.00	6,478,700	
豊和工業	10,600	839.00	8,893,400	
ニデックオーケーケー	7,600	1,328.00	10,092,800	
東洋機械金属	13,300	574.00	7,634,200	
津田駒工業	3,400	495.00	1,683,000	
エンシュウ	4,700	765.00	3,595,500	
島精機製作所	29,400	2,231.00	65,591,400	
オプトラン	25,200	2,203.00	55,515,600	
N C ホールディングス	5,700	1,868.00	10,647,600	
イワキポンプ	12,900	1,214.00	15,660,600	
フリーー	17,900	1,013.00	18,132,700	
ヤマシンフィルタ	31,800	331.00	10,525,800	
日阪製作所	20,800	832.00	17,305,600	

やまびこ	27,900	1,136.00	31,694,400
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,680.00	23,552,000
平田機工	8,800	4,555.00	40,084,000
ペガサスミシン製造	20,500	848.00	17,384,000
マルマエ	8,300	2,119.00	17,587,700
タツモ	9,400	1,391.00	13,075,400
ナブテスコ	106,800	3,275.00	349,770,000
三井海洋開発	21,400	1,420.00	30,388,000
レオン自動機	21,600	1,229.00	26,546,400
S M C	59,400	64,620.00	3,838,428,000
ホソカワミクロン	13,100	2,614.00	34,243,400
ユニオンツール	7,500	3,500.00	26,250,000
オイレス工業	26,000	1,518.00	39,468,000
日精エー・エス・ビー機械	7,800	4,155.00	32,409,000
サトーホールディングス	26,500	1,910.00	50,615,000
技研製作所	17,800	3,270.00	58,206,000
日本エアーテック	8,700	1,075.00	9,352,500
カワタ	6,000	913.00	5,478,000
日精樹脂工業	12,900	967.00	12,474,300
オカダアイヨン	6,400	1,446.00	9,254,400
ワイエイシイホールディングス	8,100	1,439.00	11,655,900
小松製作所	919,600	2,924.00	2,688,910,400
住友重機械工業	108,500	2,924.00	317,254,000
日立建機	81,400	2,901.00	236,141,400
日工	25,600	632.00	16,179,200
巴工業	7,300	2,459.00	17,950,700
井関農機	16,100	1,281.00	20,624,100
T O W A	17,400	1,868.00	32,503,200
丸山製作所	3,300	1,596.00	5,266,800
北川鉄工所	8,100	1,347.00	10,910,700
ローツェ	10,000	8,460.00	84,600,000
タカキタ	6,400	573.00	3,667,200
クボタ	907,400	2,147.00	1,948,187,800
荏原実業	8,600	2,245.00	19,307,000
三菱化工機	6,100	2,301.00	14,036,100
月島機械	31,900	906.00	28,901,400
帝国電機製作所	12,900	1,979.00	25,529,100
新東工業	38,200	717.00	27,389,400
澁谷工業	16,100	2,498.00	40,217,800
アイチ コーポレーション	29,200	834.00	24,352,800
小森コーポレーション	46,900	770.00	36,113,000
鶴見製作所	14,400	2,113.00	30,427,200

住友精密工業	3,100	2,507.00	7,771,700
日本ギア工業	7,600	333.00	2,530,800
酒井重工業	3,400	2,998.00	10,193,200
荏原製作所	69,600	5,220.00	363,312,000
石井鐵工所	2,500	2,866.00	7,165,000
西島製作所	16,700	1,347.00	22,494,900
北越工業	17,200	959.00	16,494,800
ダイキン工業	221,600	24,160.00	5,353,856,000
オルガノ	5,900	9,250.00	54,575,000
トーヨーカネツ	7,100	2,599.00	18,452,900
栗田工業	102,500	5,400.00	553,500,000
椿本チエイン	26,600	3,185.00	84,721,000
大同工業	8,600	739.00	6,355,400
木村化工機	15,900	760.00	12,084,000
アネスト岩田	31,700	955.00	30,273,500
ダイフク	95,700	8,110.00	776,127,000
サムコ	5,600	3,065.00	17,164,000
加藤製作所	10,000	773.00	7,730,000
油研工業	3,300	1,818.00	5,999,400
タダノ	98,200	984.00	96,628,800
フジテック	62,300	2,749.00	171,262,700
C K D	51,400	1,820.00	93,548,000
キトー	16,000	2,696.00	43,136,000
平和	56,600	2,088.00	118,180,800
理想科学工業	17,100	2,419.00	41,364,900
S A N K Y O	41,800	4,090.00	170,962,000
日本金銭機械	20,700	658.00	13,620,600
マースグループホールディングス	13,000	1,586.00	20,618,000
フクシマガリレイ	12,500	3,545.00	44,312,500
オーイズミ	7,400	400.00	2,960,000
ダイコク電機	9,400	1,291.00	12,135,400
竹内製作所	30,900	2,622.00	81,019,800
アマノ	53,200	2,538.00	135,021,600
J U K I	26,500	715.00	18,947,500
ジャノメ	17,400	714.00	12,423,600
マックス	24,000	1,970.00	47,280,000
グローリー	48,200	2,193.00	105,702,600
新晃工業	18,900	1,593.00	30,107,700
大和冷機工業	26,200	1,121.00	29,370,200
セガサミーホールディングス	182,400	2,042.00	372,460,800
日本ピストンリング	7,500	1,272.00	9,540,000
リケン	7,400	2,450.00	18,130,000



T P R	22,200	1,289.00	28,615,800
ツバキ・ナカシマ	42,000	1,139.00	47,838,000
ホシザキ	109,500	4,050.00	443,475,000
大豊工業	16,700	701.00	11,706,700
日本精工	347,400	758.00	263,329,200
N T N	368,900	267.00	98,496,300
ジェイテクト	173,100	986.00	170,676,600
不二越	12,600	3,835.00	48,321,000
日本トムソン	46,500	577.00	26,830,500
T H K	98,200	2,781.00	273,094,200
ユーシン精機	15,900	714.00	11,352,600
前澤給装工業	13,200	904.00	11,932,800
イーグル工業	22,000	1,151.00	25,322,000
前澤工業	12,300	649.00	7,982,700
日本ピラー工業	17,400	2,599.00	45,222,600
キッツ	62,800	806.00	50,616,800
マキタ	229,300	3,190.00	731,467,000
三井E & Sホールディングス	75,700	427.00	32,323,900
日立造船	161,100	868.00	139,834,800
三菱重工業	297,600	5,115.00	1,522,224,000
I H I	126,700	3,565.00	451,685,500
スター精密	32,900	1,796.00	59,088,400
日清紡ホールディングス	138,500	1,068.00	147,918,000
イビデン	97,700	4,250.00	415,225,000
コニカミノルタ	412,900	477.00	196,953,300
ブラザー工業	231,500	2,613.00	604,909,500
ミネベアミツミ	323,100	2,393.00	773,178,300
日立製作所	975,800	6,881.00	6,714,479,800
東芝	354,700	5,137.00	1,822,093,900
三菱電機	1,893,600	1,392.50	2,636,838,000
富士電機	112,900	5,910.00	667,239,000
東洋電機製造	6,700	908.00	6,083,600
安川電機	201,600	4,570.00	921,312,000
シンフォニアテクノロジー	20,600	1,519.00	31,291,400
明電舎	28,700	1,973.00	56,625,100
オリジン	4,600	1,407.00	6,472,200
山洋電気	7,500	5,330.00	39,975,000
デンヨー	14,400	1,642.00	23,644,800
P H Cホールディングス	31,700	1,587.00	50,307,900
東芝テック	21,800	4,135.00	90,143,000
芝浦メカトロニクス	3,700	11,620.00	42,994,000
マブチモーター	42,400	3,920.00	166,208,000

日本電産	450,800	8,939.00	4,029,701,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,400	486.00	4,082,400
トレックス・セミコンダクター	8,900	2,923.00	26,014,700
東光高岳	11,600	1,935.00	22,446,000
ダブル・スコープ	55,600	2,266.00	125,989,600
ダイヘン	18,800	4,105.00	77,174,000
ヤーマン	33,500	1,635.00	54,772,500
JVCケンウッド	168,300	205.00	34,501,500
ミマキエンジニアリング	19,100	689.00	13,159,900
I - P E X	9,900	1,374.00	13,602,600
日新電機	47,500	1,487.00	70,632,500
大崎電気工業	34,100	535.00	18,243,500
オムロン	168,900	7,225.00	1,220,302,500
日東工業	25,500	2,569.00	65,509,500
I D E C	25,100	2,826.00	70,932,600
正興電機製作所	7,700	1,075.00	8,277,500
不二電機工業	4,300	1,102.00	4,738,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	61,200	2,525.00	154,530,000
サクサホールディングス	4,700	1,301.00	6,114,700
メルコホールディングス	5,800	3,340.00	19,372,000
テクノメディカ	4,900	1,632.00	7,996,800
日本電気	240,600	4,775.00	1,148,865,000
富士通	182,600	16,260.00	2,969,076,000
沖電気工業	76,900	749.00	57,598,100
岩崎通信機	8,300	782.00	6,490,600
電気興業	9,800	2,486.00	24,362,800
サンケン電気	17,400	4,950.00	86,130,000
ナカヨ	3,300	1,094.00	3,610,200
アイホン	9,200	2,067.00	19,016,400
ルネサスエレクトロニクス	1,107,600	1,304.00	1,444,310,400
セイコーエプソン	226,600	2,188.00	495,800,800
ワコム	156,200	842.00	131,520,400
アルバック	40,400	5,380.00	217,352,000
アクセル	8,400	990.00	8,316,000
E I Z O	13,800	3,845.00	53,061,000
日本信号	43,000	928.00	39,904,000
京三製作所	39,600	429.00	16,988,400
能美防災	23,400	1,630.00	38,142,000
ホーチキ	13,200	1,343.00	17,727,600
星和電機	8,900	450.00	4,005,000
エレコム	46,800	1,683.00	78,764,400
パナソニック ホールディングス	2,163,900	1,110.00	2,401,929,000

シャープ	192,700	1,001.00	192,892,700
アンリツ	128,300	1,624.00	208,359,200
富士通ゼネラル	55,100	2,937.00	161,828,700
ソニーグループ	1,271,000	11,295.00	14,355,945,000
T D K	294,000	4,845.00	1,424,430,000
帝国通信工業	9,400	1,441.00	13,545,400
タムラ製作所	73,000	715.00	52,195,000
アルプスアルパイン	166,200	1,246.00	207,085,200
池上通信機	6,000	604.00	3,624,000
日本電波工業	20,800	1,459.00	30,347,200
鈴木	10,700	821.00	8,784,700
メイコー	22,100	3,185.00	70,388,500
日本トリム	4,100	2,405.00	9,860,500
ローランド ディー . ジー .	9,700	3,300.00	32,010,000
フォスター電機	18,900	803.00	15,176,700
S M K	4,500	2,540.00	11,430,000
ヨコオ	13,800	2,164.00	29,863,200
ホシデン	45,200	1,557.00	70,376,400
ヒロセ電機	28,100	19,430.00	545,983,000
日本航空電子工業	40,700	2,292.00	93,284,400
T O A	21,800	801.00	17,461,800
マクセル	37,400	1,461.00	54,641,400
古野電気	24,700	1,137.00	28,083,900
ユニデンホールディングス	4,400	4,090.00	17,996,000
スミダコーポレーション	16,200	976.00	15,811,200
アイコム	6,500	2,621.00	17,036,500
リオン	7,300	2,139.00	15,614,700
本多通信工業	16,600	703.00	11,669,800
横河電機	186,100	2,429.00	452,036,900
新電元工業	7,200	3,670.00	26,424,000
アズビル	117,700	3,890.00	457,853,000
東亜ディーケーケー	10,800	845.00	9,126,000
日本光電工業	78,000	3,050.00	237,900,000
チノー	6,400	1,646.00	10,534,400
共和電業	17,700	343.00	6,071,100
日本電子材料	9,500	1,583.00	15,038,500
堀場製作所	37,500	6,230.00	233,625,000
アドバンテスト	150,800	8,010.00	1,207,908,000
小野測器	8,400	417.00	3,502,800
エスペック	15,300	1,835.00	28,075,500
キーエンス	183,800	52,100.00	9,575,980,000
日置電機	8,900	6,630.00	59,007,000

シスメックス	145,300	8,368.00	1,215,870,400
日本マイクロニクス	28,200	1,413.00	39,846,600
メガチップス	18,200	2,726.00	49,613,200
O B A R A G R O U P	8,100	3,285.00	26,608,500
澤藤電機	2,900	1,279.00	3,709,100
原田工業	10,400	812.00	8,444,800
コーセル	23,200	876.00	20,323,200
イリソ電子工業	17,200	4,070.00	70,004,000
オブテックスグループ	31,200	2,023.00	63,117,600
千代田インテグレ	7,100	2,167.00	15,385,700
レーザーテック	83,200	19,070.00	1,586,624,000
スタンレー電気	131,000	2,529.00	331,299,000
岩崎電気	6,600	2,576.00	17,001,600
ウシオ電機	96,300	1,697.00	163,421,100
岡谷電機産業	16,900	243.00	4,106,700
ヘリオス テクノ ホールディング	18,900	376.00	7,106,400
エノモト	6,000	1,556.00	9,336,000
日本セラミック	17,400	2,589.00	45,048,600
遠藤照明	10,100	779.00	7,867,900
古河電池	15,000	1,158.00	17,370,000
双信電機	11,100	452.00	5,017,200
山一電機	13,500	2,019.00	27,256,500
図研	13,400	3,405.00	45,627,000
日本電子	39,100	5,560.00	217,396,000
カシオ計算機	125,500	1,310.00	164,405,000
ファナック	178,100	22,445.00	3,997,454,500
日本シイエムケイ	37,100	473.00	17,548,300
エンプラス	5,200	4,200.00	21,840,000
大真空	25,700	966.00	24,826,200
ローム	84,400	10,240.00	864,256,000
浜松ホトニクス	135,300	5,850.00	791,505,000
三井ハイテック	17,500	8,530.00	149,275,000
新光電気工業	59,800	3,790.00	226,642,000
京セラ	285,500	7,576.00	2,162,948,000
太陽誘電	90,400	4,300.00	388,720,000
村田製作所	553,500	7,468.00	4,133,538,000
双葉電子工業	35,700	664.00	23,704,800
北陸電気工業	8,100	1,091.00	8,837,100
ニチコン	54,500	1,438.00	78,371,000
日本ケミコン	19,500	1,838.00	35,841,000
K O A	28,300	2,303.00	65,174,900
市光工業	25,900	380.00	9,842,000

小糸製作所	101,400	4,570.00	463,398,000
ミツバ	31,600	431.00	13,619,600
S C R E E Nホールディングス	32,000	9,410.00	301,120,000
キャノン電子	19,000	1,668.00	31,692,000
キャノン	924,200	3,386.00	3,129,341,200
リコー	482,700	1,083.00	522,764,100
象印マホービン	50,700	1,603.00	81,272,100
M U T O Hホールディングス	2,900	1,951.00	5,657,900
東京エレクトロン	128,700	43,530.00	5,602,311,000
トヨタ紡織	70,900	2,004.00	142,083,600
芦森工業	3,800	1,025.00	3,895,000
ユニプレス	33,300	946.00	31,501,800
豊田自動織機	143,700	7,690.00	1,105,053,000
モリタホールディングス	32,500	1,269.00	41,242,500
三櫻工業	28,100	762.00	21,412,200
デンソー	397,100	7,555.00	3,000,090,500
東海理化電機製作所	53,400	1,501.00	80,153,400
川崎重工業	137,500	2,600.00	357,500,000
名村造船所	52,300	633.00	33,105,900
日本車輛製造	6,500	2,155.00	14,007,500
三菱ロジスネクスト	26,900	853.00	22,945,700
近畿車輛	3,000	1,024.00	3,072,000
日産自動車	2,392,800	531.70	1,272,251,760
いすゞ自動車	587,700	1,731.00	1,017,308,700
トヨタ自動車	9,249,400	2,090.00	19,331,246,000
日野自動車	253,400	629.00	159,388,600
三菱自動車工業	751,000	538.00	404,038,000
エフテック	13,000	516.00	6,708,000
レシップホールディングス	8,000	531.00	4,248,000
G M B	3,700	724.00	2,678,800
ファルテック	3,500	591.00	2,068,500
武蔵精密工業	45,200	1,652.00	74,670,400
日産車体	29,700	771.00	22,898,700
新明和工業	52,900	1,077.00	56,973,300
極東開発工業	32,300	1,363.00	44,024,900
トピー工業	15,200	1,391.00	21,143,200
ティラド	5,500	2,786.00	15,323,000
曙ブレーキ工業	111,400	168.00	18,715,200
タチエス	33,300	1,198.00	39,893,400
N O K	76,300	1,221.00	93,162,300
フタバ産業	45,100	362.00	16,326,200
K Y B	17,800	3,265.00	58,117,000

大同メタル工業	38,900	531.00	20,655,900
プレス工業	90,900	435.00	39,541,500
ミクニ	23,600	327.00	7,717,200
太平洋工業	38,600	1,086.00	41,919,600
河西工業	24,900	239.00	5,951,100
アイシン	148,500	4,110.00	610,335,000
マツダ	597,000	1,226.00	731,922,000
今仙電機製作所	13,300	572.00	7,607,600
本田技研工業	1,483,400	3,669.00	5,442,594,600
スズキ	402,200	4,771.00	1,918,896,200
S U B A R U	533,000	2,448.00	1,304,784,000
安永	8,200	693.00	5,682,600
ヤマハ発動機	264,700	2,860.00	757,042,000
T B K	20,400	322.00	6,568,800
エクセディ	30,600	1,823.00	55,783,800
豊田合成	57,300	2,386.00	136,717,800
愛三工業	31,800	733.00	23,309,400
盟和産業	2,900	992.00	2,876,800
日本プラスト	14,700	455.00	6,688,500
ヨロズ	15,800	888.00	14,030,400
エフ・シー・シー	33,200	1,465.00	48,638,000
シマノ	68,900	23,760.00	1,637,064,000
テイ・エス テック	85,700	1,560.00	133,692,000
ジャムコ	11,800	1,267.00	14,950,600
テルモ	574,100	4,448.00	2,553,596,800
クリエートメディック	6,100	938.00	5,721,800
日機装	42,100	1,008.00	42,436,800
日本エム・ディ・エム	11,700	1,380.00	16,146,000
島津製作所	242,500	4,050.00	982,125,000
J M S	15,600	560.00	8,736,000
長野計器	13,500	1,107.00	14,944,500
ブイ・テクノロジー	8,900	2,938.00	26,148,200
東京計器	12,900	1,285.00	16,576,500
愛知時計電機	7,300	1,441.00	10,519,300
インターアクション	10,200	1,825.00	18,615,000
オーバル	18,200	493.00	8,972,600
東京精密	31,700	4,650.00	147,405,000
マニー	74,100	1,749.00	129,600,900
ニコン	286,000	1,592.00	455,312,000
トプコン	95,400	1,854.00	176,871,600
オリンパス	972,000	2,959.00	2,876,148,000
理研計器	13,400	4,250.00	56,950,000

タムロン	12,600	3,005.00	37,863,000
HOYA	391,700	14,240.00	5,577,808,000
シード	9,500	559.00	5,310,500
ノーリツ銅機	16,000	2,452.00	39,232,000
A & Dホロンホールディングス	22,800	920.00	20,976,000
朝日インテック	222,500	2,423.00	539,117,500
シチズン時計	198,100	597.00	118,265,700
リズム	6,400	1,433.00	9,171,200
大研医器	16,100	472.00	7,599,200
メニコン	62,600	3,310.00	207,206,000
シンシア	1,800	451.00	811,800
松風	6,800	2,161.00	14,694,800
セイコーホールディングス	28,700	2,806.00	80,532,200
ニプロ	140,400	1,109.00	155,703,600
中本パックス	5,700	1,594.00	9,085,800
スノーピーク	28,800	2,221.00	63,964,800
パラマウントベッドホールディングス	38,900	2,616.00	101,762,400
トランザクション	13,000	1,115.00	14,495,000
粧美堂	5,100	410.00	2,091,000
ニホンフラッシュ	15,800	951.00	15,025,800
前田工織	18,300	3,330.00	60,939,000
永大産業	22,100	253.00	5,591,300
アートネイチャー	17,300	725.00	12,542,500
バンダイナムコホールディングス	167,800	10,285.00	1,725,823,000
アイフィスジャパン	5,200	601.00	3,125,200
共立印刷	27,800	148.00	4,114,400
SHOEI	17,800	5,440.00	96,832,000
フランスベッドホールディングス	26,100	956.00	24,951,600
パイロットコーポレーション	26,300	4,915.00	129,264,500
萩原工業	11,300	1,113.00	12,576,900
フジシールインターナショナル	41,700	1,506.00	62,800,200
タカラトミー	83,800	1,335.00	111,873,000
広済堂ホールディングス	12,600	1,182.00	14,893,200
エステールホールディングス	4,300	622.00	2,674,600
タカノ	6,900	732.00	5,050,800
プロネクサス	15,700	1,008.00	15,825,600
ホクシン	14,300	156.00	2,230,800
ウッドワン	6,200	1,073.00	6,652,600
大建工業	10,200	1,957.00	19,961,400
凸版印刷	264,300	2,148.00	567,716,400
大日本印刷	219,800	2,887.00	634,562,600
共同印刷	5,300	2,414.00	12,794,200

N I S S H A	32,000	1,790.00	57,280,000
光村印刷	1,600	1,223.00	1,956,800
T A K A R A & C O M P A N Y	11,600	2,017.00	23,397,200
アシックス	155,500	2,490.00	387,195,000
ツツミ	5,100	1,983.00	10,113,300
ローランド	12,400	4,065.00	50,406,000
小松ウオール工業	6,200	1,901.00	11,786,200
ヤマハ	118,000	5,410.00	638,380,000
河合楽器製作所	5,100	2,750.00	14,025,000
クリナップ	18,900	614.00	11,604,600
ピジョン	107,300	2,091.00	224,364,300
兼松サステック	1,300	1,646.00	2,139,800
キングジム	14,900	904.00	13,469,600
リンテック	38,600	2,294.00	88,548,400
イトーキ	34,500	449.00	15,490,500
任天堂	114,500	57,240.00	6,553,980,000
三菱鉛筆	24,300	1,388.00	33,728,400
タカラスタANDARD	32,600	1,330.00	43,358,000
コクヨ	81,100	1,783.00	144,601,300
ナカバヤシ	16,300	514.00	8,378,200
グローブライド	15,100	2,776.00	41,917,600
オカムラ	57,000	1,329.00	75,753,000
美津濃	16,700	2,691.00	44,939,700
東京電力ホールディングス	1,518,400	527.00	800,196,800
中部電力	573,000	1,411.00	808,503,000
関西電力	709,600	1,327.00	941,639,200
中国電力	292,700	843.00	246,746,100
北陸電力	172,200	517.00	89,027,400
東北電力	443,500	703.00	311,780,500
四国電力	168,600	816.00	137,577,600
九州電力	388,300	838.00	325,395,400
北海道電力	176,300	516.00	90,970,800
沖縄電力	43,000	1,134.00	48,762,000
電源開発	149,900	2,136.00	320,186,400
エフオン	12,300	687.00	8,450,100
イーレックス	26,100	2,772.00	72,349,200
レノバ	39,800	2,889.00	114,982,200
東京瓦斯	361,100	2,597.00	937,776,700
大阪瓦斯	341,200	2,370.00	808,644,000
東邦瓦斯	79,600	3,170.00	252,332,000
北海道瓦斯	10,100	1,643.00	16,594,300
広島ガス	35,500	329.00	11,679,500



西部ガスホールディングス	19,300	1,756.00	33,890,800
静岡ガス	38,400	1,062.00	40,780,800
メタウォーター	21,100	2,042.00	43,086,200
SBSホールディングス	15,000	2,864.00	42,960,000
東武鉄道	185,000	3,190.00	590,150,000
相鉄ホールディングス	60,300	2,365.00	142,609,500
東急	472,300	1,617.00	763,709,100
京浜急行電鉄	225,800	1,388.00	313,410,400
小田急電鉄	255,300	1,854.00	473,326,200
京王電鉄	89,100	5,150.00	458,865,000
京成電鉄	119,500	3,690.00	440,955,000
富士急行	20,700	4,045.00	83,731,500
新京成電鉄	4,700	3,015.00	14,170,500
東日本旅客鉄道	309,500	6,940.00	2,147,930,000
西日本旅客鉄道	215,200	5,212.00	1,121,622,400
東海旅客鉄道	142,700	15,875.00	2,265,362,500
西武ホールディングス	244,500	1,372.00	335,454,000
鴻池運輸	28,700	1,315.00	37,740,500
西日本鉄道	48,700	2,798.00	136,262,600
ハマキョウレックス	13,200	3,170.00	41,844,000
サカイ引越センター	9,300	4,800.00	44,640,000
近鉄グループホールディングス	180,200	4,585.00	826,217,000
阪急阪神ホールディングス	224,200	4,040.00	905,768,000
南海電気鉄道	80,400	2,688.00	216,115,200
京阪ホールディングス	74,900	3,430.00	256,907,000
神戸電鉄	4,600	3,345.00	15,387,000
名古屋鉄道	185,900	2,089.00	388,345,100
山陽電気鉄道	13,700	2,276.00	31,181,200
アルプス物流	13,400	1,118.00	14,981,200
ヤマトホールディングス	263,200	2,187.00	575,618,400
山九	46,700	4,235.00	197,774,500
丸運	9,100	231.00	2,102,100
丸全昭和運輸	13,000	3,205.00	41,665,000
センコーグループホールディングス	89,000	952.00	84,728,000
トナミホールディングス	3,700	3,700.00	13,690,000
ニッコンホールディングス	58,000	2,336.00	135,488,000
日本石油輸送	2,100	2,428.00	5,098,800
福山通運	24,600	3,130.00	76,998,000
セイノーホールディングス	104,700	1,111.00	116,321,700
エスライン	5,200	820.00	4,264,000
神奈川中央交通	4,800	3,740.00	17,952,000
日立物流	37,100	8,780.00	325,738,000

丸和運輸機関	32,500	1,652.00	53,690,000
C & F ロジホールディングス	16,200	1,217.00	19,715,400
九州旅客鉄道	128,800	2,851.00	367,208,800
S Gホールディングス	322,700	2,283.00	736,724,100
NIPPON EXPRESSホールディングス	62,800	7,590.00	476,652,000
日本郵船	160,900	10,690.00	1,720,021,000
商船三井	297,000	3,700.00	1,098,900,000
川崎汽船	59,400	8,940.00	531,036,000
NSユニテッド海運	9,600	5,060.00	48,576,000
飯野海運	78,300	842.00	65,928,600
共栄タンカー	5,900	922.00	5,439,800
乾汽船	12,600	2,087.00	26,296,200
日本航空	413,000	2,512.00	1,037,456,000
ANAホールディングス	457,600	2,625.50	1,201,428,800
パスコ	3,600	1,315.00	4,734,000
ランコム	5,400	7,490.00	40,446,000
日新	14,000	1,825.00	25,550,000
三菱倉庫	46,500	3,595.00	167,167,500
三井倉庫ホールディングス	18,800	3,410.00	64,108,000
住友倉庫	56,400	2,185.00	123,234,000
澁澤倉庫	9,600	2,099.00	20,150,400
東陽倉庫	27,200	280.00	7,616,000
日本トランスシティ	33,800	510.00	17,238,000
ケイヒン	3,300	1,443.00	4,761,900
中央倉庫	9,900	960.00	9,504,000
川西倉庫	3,500	1,063.00	3,720,500
安田倉庫	12,900	935.00	12,061,500
ファイズホールディングス	4,100	999.00	4,095,900
東洋埠頭	5,400	1,230.00	6,642,000
上組	91,300	2,693.00	245,870,900
サンリツ	4,900	695.00	3,405,500
キムラユニティー	10,000	814.00	8,140,000
キューソー流通システム	11,200	1,270.00	14,224,000
東海運	10,900	282.00	3,073,800
エーアイティー	12,100	1,666.00	20,158,600
内外トランスライン	6,100	2,142.00	13,066,200
日本コンセプト	5,200	1,731.00	9,001,200
NEC ネットズエスアイ	66,000	1,670.00	110,220,000
クロスキャット	10,900	1,304.00	14,213,600
システナ	284,600	417.00	118,678,200
デジタルアーツ	10,700	6,610.00	70,727,000
日鉄ソリューションズ	34,700	3,730.00	129,431,000

キューブシステム	10,300	1,032.00	10,629,600
WOW WORLD	3,000	851.00	2,553,000
コア	8,600	1,496.00	12,865,600
手間いらず	2,900	4,820.00	13,978,000
ラクーンホールディングス	17,100	1,343.00	22,965,300
ソリトンシステムズ	8,900	1,215.00	10,813,500
ソフトクリエイイトホールディングス	8,700	3,845.00	33,451,500
T I S	174,100	3,905.00	679,860,500
J N Sホールディングス	9,800	401.00	3,929,800
グリー	90,900	835.00	75,901,500
G M Oペパボ	2,500	1,940.00	4,850,000
コーエーテクモホールディングス	63,600	4,595.00	292,242,000
三菱総合研究所	8,300	4,110.00	34,113,000
電算	2,300	2,027.00	4,662,100
A G S	8,200	711.00	5,830,200
ファインデックス	13,700	662.00	9,069,400
ブレインパッド	17,100	1,104.00	18,878,400
K L a b	31,600	400.00	12,640,000
ポルトゥウィンホールディングス	29,100	1,011.00	29,420,100
ネクソン	454,600	2,753.00	1,251,513,800
アイスタイル	51,900	509.00	26,417,100
エムアップホールディングス	23,200	1,424.00	33,036,800
エイチーム	12,800	750.00	9,600,000
エニグモ	21,900	554.00	12,132,600
テクノスジャパン	15,900	458.00	7,282,200
コロプラ	65,900	682.00	44,943,800
ブロードリーフ	99,200	507.00	50,294,400
クロス・マーケティンググループ	7,800	865.00	6,747,000
デジタルハーツホールディングス	9,200	1,764.00	16,228,800
システム情報	15,200	984.00	14,956,800
メディアドゥ	6,900	2,041.00	14,082,900
じげん	57,000	335.00	19,095,000
ブイキューブ	20,400	1,290.00	26,316,000
エンカレッジ・テクノロジー	4,800	517.00	2,481,600
サイバーリンクス	6,200	1,144.00	7,092,800
フィックスターズ	19,300	1,228.00	23,700,400
C A R T A H O L D I N G S	8,300	1,757.00	14,583,100
オブティム	14,200	888.00	12,609,600
セレス	6,900	1,146.00	7,907,400
S H I F T	12,400	19,490.00	241,676,000
ティーガイア	17,800	1,654.00	29,441,200
セック	3,000	2,280.00	6,840,000

テクマトリックス	33,800	1,745.00	58,981,000
プロシップ	6,700	1,439.00	9,641,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	51,800	2,273.00	117,741,400
GMOペイメントゲートウェイ	38,600	10,880.00	419,968,000
ザッパラス	7,500	311.00	2,332,500
システムリサーチ	5,900	1,989.00	11,735,100
インターネットイニシアティブ	53,100	4,790.00	254,349,000
さくらインターネット	21,700	583.00	12,651,100
ヴィンクス	5,700	1,522.00	8,675,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,200	5,140.00	26,728,000
SRAホールディングス	9,700	2,943.00	28,547,100
システムインテグレータ	6,800	464.00	3,155,200
朝日ネット	18,500	622.00	11,507,000
eBASE	24,200	549.00	13,285,800
アバント	21,500	1,493.00	32,099,500
アドソル日進	7,200	1,580.00	11,376,000
ODKソリューションズ	4,500	585.00	2,632,500
フリービット	10,600	891.00	9,444,600
コムチュア	22,400	2,417.00	54,140,800
サイバーコム	3,200	1,261.00	4,035,200
アステリア	14,600	805.00	11,753,000
アイル	9,600	1,721.00	16,521,600
マークラインズ	9,300	2,209.00	20,543,700
メディカル・データ・ビジョン	25,400	1,139.00	28,930,600
gumi	27,900	754.00	21,036,600
ショーケース	4,900	410.00	2,009,000
モバイルファクトリー	4,200	951.00	3,994,200
テラスカイ	7,400	1,884.00	13,941,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,000	1,503.00	13,527,000
PCIホールディングス	8,000	971.00	7,768,000
アイビーシー	3,400	414.00	1,407,600
ネオジャパン	5,800	1,123.00	6,513,400
PR TIMES	4,300	2,453.00	10,547,900
ラクス	91,400	1,616.00	147,702,400
ランドコンピュータ	4,800	873.00	4,190,400
ダブルスタンダード	6,100	2,392.00	14,591,200
オープンドア	11,900	1,966.00	23,395,400
マイネット	6,500	504.00	3,276,000
アカツキ	9,000	2,407.00	21,663,000
ベネフィットジャパン	1,600	1,587.00	2,539,200
Ubicomホールディングス	5,300	2,615.00	13,859,500
カナミックネットワーク	24,700	567.00	14,004,900

ノムラシステムコーポレーション	19,400	141.00	2,735,400
チェンジ	41,500	1,915.00	79,472,500
シンクロ・フード	10,700	442.00	4,729,400
オークネット	8,900	2,119.00	18,859,100
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	705.00	2,749,500
セグエグループ	5,600	714.00	3,998,400
エイトレッド	2,900	1,844.00	5,347,600
マクロミル	38,500	1,066.00	41,041,000
ビーグリー	3,300	1,318.00	4,349,400
オロ	5,200	1,541.00	8,013,200
ユーザーローカル	6,200	1,590.00	9,858,000
テモナ	4,300	321.00	1,380,300
ニーズウェル	6,100	638.00	3,891,800
マネーフォワード	40,600	3,410.00	138,446,000
サインポスト	6,400	879.00	5,625,600
電算システムホールディングス	8,300	2,327.00	19,314,100
ソルクシーズ	15,800	376.00	5,940,800
フェイス	5,600	570.00	3,192,000
プロトコーポレーション	21,300	1,126.00	23,983,800
ハイマックス	5,400	1,397.00	7,543,800
野村総合研究所	346,300	3,725.00	1,289,967,500
サイバネットシステム	14,400	951.00	13,694,400
C Eホールディングス	10,100	508.00	5,130,800
日本システム技術	3,600	2,600.00	9,360,000
インテージホールディングス	23,100	1,555.00	35,920,500
東邦システムサイエンス	5,500	995.00	5,472,500
ソースネクスト	86,800	245.00	21,266,000
インフォコム	21,900	1,991.00	43,602,900
シンプレクス・ホールディングス	31,600	2,052.00	64,843,200
HEROZ	5,900	860.00	5,074,000
ラクスル	23,900	2,082.00	49,759,800
メルカリ	76,000	2,247.00	170,772,000
I P S	5,600	2,807.00	15,719,200
F I G	22,400	389.00	8,713,600
システムサポート	7,400	1,411.00	10,441,400
イーソル	11,200	646.00	7,235,200
アルテリア・ネットワークス	19,100	1,297.00	24,772,700
東海ソフト	3,300	936.00	3,088,800
ウイングアーク1st	15,300	1,729.00	26,453,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,786.00	8,394,200
サーバーワークス	3,500	2,768.00	9,688,000
東名	1,600	1,074.00	1,718,400

ヴィッツ	2,100	1,087.00	2,282,700
トピラシステムズ	4,900	987.00	4,836,300
Sansan	63,100	1,269.00	80,073,900
Link-U	3,900	744.00	2,901,600
ギフトィ	18,300	1,973.00	36,105,900
ベース	2,900	6,630.00	19,227,000
JMDC	25,000	6,590.00	164,750,000
フォーカスシステムズ	12,600	988.00	12,448,800
クレスコ	14,600	1,813.00	26,469,800
フジ・メディア・ホールディングス	177,300	1,101.00	195,207,300
オービック	62,800	20,660.00	1,297,448,000
ジャストシステム	28,400	3,580.00	101,672,000
TDCソフト	16,000	1,177.00	18,832,000
Zホールディングス	2,871,500	412.70	1,185,068,050
トレンドマイクロ	97,600	8,490.00	828,624,000
IDホールディングス	12,800	892.00	11,417,600
日本オラクル	32,300	8,380.00	270,674,000
アルファシステムズ	5,400	4,650.00	25,110,000
フューチャー	42,200	1,660.00	70,052,000
CAC Holdings	10,500	1,427.00	14,983,500
SBテクノロジー	8,700	2,420.00	21,054,000
トーセ	5,200	801.00	4,165,200
オービックビジネスコンサルタント	19,000	4,850.00	92,150,000
伊藤忠テクノソリューションズ	90,800	3,470.00	315,076,000
アイティフォー	24,400	787.00	19,202,800
東計電算	2,400	6,490.00	15,576,000
エクスネット	3,300	1,001.00	3,303,300
大塚商会	95,800	4,510.00	432,058,000
サイボウズ	23,500	1,358.00	31,913,000
電通国際情報サービス	20,600	4,410.00	90,846,000
ACCESS	22,800	800.00	18,240,000
デジタルガレージ	33,000	3,870.00	127,710,000
EMシステムズ	28,400	999.00	28,371,600
ウェザーニューズ	6,000	7,940.00	47,640,000
CIJ	15,700	753.00	11,822,100
ビジネスエンジニアリング	4,600	2,382.00	10,957,200
日本エンタープライズ	20,900	167.00	3,490,300
WOWOW	8,300	1,369.00	11,362,700
スカラ	17,000	748.00	12,716,000
インテリジェント ウェイブ	10,200	858.00	8,751,600
IMAGICA GROUP	14,400	878.00	12,643,200
ネットワンシステムズ	73,500	3,090.00	227,115,000

システムソフト	61,000	109.00	6,649,000
アルゴグラフィックス	15,600	3,735.00	58,266,000
マーベラス	31,700	677.00	21,460,900
エイベックス	34,500	1,579.00	54,475,500
B I P R O G Y	62,300	3,045.00	189,703,500
兼松エレクトロニクス	10,900	4,155.00	45,289,500
都築電気	9,100	1,350.00	12,285,000
T B S ホールディングス	97,400	1,612.00	157,008,800
日本テレビホールディングス	166,400	1,186.00	197,350,400
朝日放送グループホールディングス	16,200	650.00	10,530,000
テレビ朝日ホールディングス	48,000	1,435.00	68,880,000
スカパーJ S A Tホールディングス	169,000	570.00	96,330,000
テレビ東京ホールディングス	12,400	1,980.00	24,552,000
日本BS放送	7,000	973.00	6,811,000
ビジョン	22,400	1,269.00	28,425,600
スマートバリュー	5,000	506.00	2,530,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	15,300	2,107.00	32,237,100
ワイヤレスゲート	9,000	281.00	2,529,000
コネクシオ	14,300	1,310.00	18,733,000
クロップス	3,900	947.00	3,693,300
日本電信電話	2,231,600	3,753.00	8,375,194,800
K D D I	1,451,500	4,214.00	6,116,621,000
ソフトバンク	3,015,700	1,504.50	4,537,120,650
光通信	23,000	17,440.00	401,120,000
エムティーアイ	15,900	492.00	7,822,800
G M O インターネット	62,900	2,517.00	158,319,300
ファイバーゲート	9,300	1,012.00	9,411,600
アйдママーケティングコミュニケーション	5,000	290.00	1,450,000
K A D O K A W A	107,300	2,944.00	315,891,200
学研ホールディングス	28,400	964.00	27,377,600
ゼンリン	32,800	936.00	30,700,800
昭文社ホールディングス	8,700	317.00	2,757,900
インプレスホールディングス	17,500	208.00	3,640,000
アイネット	9,400	1,329.00	12,492,600
松竹	11,400	12,180.00	138,852,000
東宝	117,500	5,230.00	614,525,000
東映	5,600	18,250.00	102,200,000
エヌ・ティ・ティ・データ	530,200	1,924.00	1,020,104,800
ピー・シー・エー	11,800	1,061.00	12,519,800
ビジネスブレイン太田昭和	6,800	1,524.00	10,363,200
D T S	37,200	3,460.00	128,712,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	92,700	5,960.00	552,492,000

シーイーシー	21,500	1,307.00	28,100,500
カブコン	187,800	3,685.00	692,043,000
アイ・エス・ピー	8,800	1,265.00	11,132,000
ジャステック	10,600	1,211.00	12,836,600
S C S K	137,900	2,206.00	304,207,400
N S W	7,600	2,288.00	17,388,800
アイネス	17,300	1,571.00	27,178,300
T K C	30,400	3,440.00	104,576,000
富士ソフト	19,100	8,150.00	155,665,000
N S D	62,500	2,419.00	151,187,500
コナミグループ	72,300	7,090.00	512,607,000
福井コンピュータホールディングス	9,200	3,650.00	33,580,000
J B C Cホールディングス	13,600	1,788.00	24,316,800
ミロク情報サービス	17,700	1,511.00	26,744,700
ソフトバンクグループ	1,193,900	5,496.00	6,561,674,400
高千穂交易	7,100	2,234.00	15,861,400
オルパヘルスケアホールディングス	3,300	1,528.00	5,042,400
伊藤忠食品	4,000	5,090.00	20,360,000
エレマテック	16,000	1,357.00	21,712,000
あらた	14,800	4,300.00	63,640,000
トーメンデバイス	3,000	5,510.00	16,530,000
東京エレクトロン デバイス	5,900	5,770.00	34,043,000
フィールズ	17,500	1,329.00	23,257,500
双日	205,000	2,320.00	475,600,000
アルフレッサ ホールディングス	207,300	1,644.00	340,801,200
横浜冷凍	48,600	922.00	44,809,200
ラサ商事	9,100	974.00	8,863,400
アルコニックス	25,400	1,418.00	36,017,200
神戸物産	137,900	3,570.00	492,303,000
ハイパー	3,800	441.00	1,675,800
あい ホールディングス	28,500	2,048.00	58,368,000
ディーブイエックス	6,800	927.00	6,303,600
ダイワボウホールディングス	85,000	1,930.00	164,050,000
マクニカホールディングス	47,700	2,907.00	138,663,900
ラクト・ジャパン	6,900	2,322.00	16,021,800
グリムス	8,900	1,766.00	15,717,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,900	668.00	21,309,200
八洲電機	14,500	1,013.00	14,688,500
メディアスホールディングス	11,400	805.00	9,177,000
レスターホールディングス	19,000	2,054.00	39,026,000
ジュテックホールディングス	3,900	1,100.00	4,290,000
大光	8,500	707.00	6,009,500



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	96,800	887.00	85,861,600
黒谷	5,500	627.00	3,448,500
Cominix	3,500	721.00	2,523,500
三洋貿易	18,300	1,013.00	18,537,900
ビューティガレージ	3,200	2,876.00	9,203,200
ウイン・パートナーズ	14,500	991.00	14,369,500
ミタチ産業	5,100	774.00	3,947,400
シップヘルスケアホールディングス	57,700	2,532.00	146,096,400
明治電機工業	6,000	1,065.00	6,390,000
デリカフーズホールディングス	7,800	520.00	4,056,000
スターティアホールディングス	4,600	960.00	4,416,000
コメダホールディングス	43,600	2,308.00	100,628,800
ピーバンドットコム	2,900	509.00	1,476,100
アセンテック	6,900	628.00	4,333,200
富士興産	5,000	1,206.00	6,030,000
協栄産業	2,000	1,421.00	2,842,000
フルサト・マルカホールディングス	17,700	3,230.00	57,171,000
ヤマエグループホールディングス	11,200	1,660.00	18,592,000
小野建	17,900	1,483.00	26,545,700
南陽	3,800	1,891.00	7,185,800
佐島電機	12,500	1,166.00	14,575,000
エコートレーディング	4,300	573.00	2,463,900
伯東	11,700	3,260.00	38,142,000
コンドーテック	15,000	1,018.00	15,270,000
中山福	10,700	311.00	3,327,700
ナガイレーベン	24,100	2,037.00	49,091,700
三菱食品	19,200	3,385.00	64,992,000
松田産業	14,600	2,454.00	35,828,400
第一興商	37,900	3,935.00	149,136,500
メディバルホールディングス	184,900	1,913.00	353,713,700
SPK	7,900	1,399.00	11,052,100
萩原電気ホールディングス	6,800	2,325.00	15,810,000
アズワン	28,700	6,410.00	183,967,000
スズデン	6,300	2,058.00	12,965,400
尾家産業	4,700	875.00	4,112,500
シモジマ	12,300	1,082.00	13,308,600
ドウシシャ	18,900	1,525.00	28,822,500
小津産業	4,400	1,820.00	8,008,000
高速	10,600	1,503.00	15,931,800
たけびし	6,800	1,521.00	10,342,800
リックス	4,100	1,917.00	7,859,700

丸文	16,000	792.00	12,672,000
ハピネット	15,200	1,607.00	24,426,400
橋本総業ホールディングス	3,500	2,002.00	7,007,000
日本ライフライン	59,200	1,024.00	60,620,800
タカショー	15,600	711.00	11,091,600
I D O M	60,700	827.00	50,198,900
進和	11,800	2,255.00	26,609,000
エスケイジャパン	4,900	561.00	2,748,900
ダイトロン	7,000	2,073.00	14,511,000
シークス	25,400	1,064.00	27,025,600
田中商事	6,200	568.00	3,521,600
オーハシテクニカ	9,900	1,410.00	13,959,000
白銅	6,400	2,666.00	17,062,400
ダイコー通産	2,400	1,100.00	2,640,000
伊藤忠商事	1,198,000	3,835.00	4,594,330,000
丸紅	1,731,100	1,432.00	2,478,935,200
高島	2,900	2,556.00	7,412,400
長瀬産業	91,400	1,993.00	182,160,200
蝶理	11,200	2,033.00	22,769,600
豊田通商	178,400	4,885.00	871,484,000
三共生興	25,700	467.00	12,001,900
兼松	69,200	1,516.00	104,907,200
ツカモトコーポレーション	3,300	1,063.00	3,507,900
三井物産	1,448,500	3,259.00	4,720,661,500
日本紙パルプ商事	9,500	4,330.00	41,135,000
カメイ	21,400	1,094.00	23,411,600
東都水産	1,000	4,925.00	4,925,000
O U Gホールディングス	2,900	2,937.00	8,517,300
スターゼン	13,500	2,104.00	28,404,000
山善	72,100	932.00	67,197,200
椿本興業	3,300	3,735.00	12,325,500
住友商事	1,182,400	1,950.00	2,305,680,000
内田洋行	7,900	4,895.00	38,670,500
三菱商事	1,310,200	4,528.00	5,932,585,600
第一実業	7,700	3,795.00	29,221,500
キャノンマーケティングジャパン	41,300	3,215.00	132,779,500
西華産業	8,600	1,644.00	14,138,400
佐藤商事	13,800	1,148.00	15,842,400
菱洋エレクトロ	11,800	2,252.00	26,573,600
東京産業	16,300	794.00	12,942,200
ユアサ商事	16,100	3,465.00	55,786,500
神鋼商事	4,500	4,185.00	18,832,500

トルク	10,800	202.00	2,181,600
阪和興業	34,700	3,495.00	121,276,500
正栄食品工業	11,900	4,005.00	47,659,500
カナデン	16,300	1,050.00	17,115,000
菱電商事	15,800	1,638.00	25,880,400
岩谷産業	44,300	5,570.00	246,751,000
ナイス	6,100	1,622.00	9,894,200
ニチモウ	2,400	2,522.00	6,052,800
極東貿易	5,700	2,704.00	15,412,800
アステナホールディングス	30,900	445.00	13,750,500
三愛オブリ	44,800	1,093.00	48,966,400
稲畑産業	40,000	2,435.00	97,400,000
G S I クレオス	9,600	1,548.00	14,860,800
明和産業	18,500	797.00	14,744,500
クワザワホールディングス	7,200	431.00	3,103,200
ワキタ	36,100	1,102.00	39,782,200
東邦ホールディングス	54,300	1,825.00	99,097,500
サンゲツ	48,500	1,669.00	80,946,500
ミツウロコグループホールディングス	23,000	1,001.00	23,023,000
シナネンホールディングス	6,600	3,830.00	25,278,000
伊藤忠エネクス	44,200	1,099.00	48,575,800
サンリオ	56,100	3,560.00	199,716,000
サンワテクノス	10,100	1,414.00	14,281,400
リョーサン	20,500	2,227.00	45,653,500
新光商事	26,400	978.00	25,819,200
トーホー	7,700	1,317.00	10,140,900
三信電気	8,200	1,674.00	13,726,800
東陽テクニカ	19,800	1,322.00	26,175,600
モスフードサービス	26,200	3,195.00	83,709,000
加賀電子	16,300	3,975.00	64,792,500
ソーダニッカ	16,000	611.00	9,776,000
立花エレテック	13,000	1,650.00	21,450,000
フォーバル	7,000	999.00	6,993,000
P A L T A C	28,000	4,010.00	112,280,000
三谷産業	31,300	307.00	9,609,100
西本Wismettacホールディングス	4,500	3,865.00	17,392,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,800	1,620.00	2,916,000
コア商事ホールディングス	12,500	707.00	8,837,500
国際紙パルプ商事	37,000	708.00	26,196,000
ヤマタネ	8,600	1,613.00	13,871,800
丸紅建材リース	1,800	1,910.00	3,438,000
日鉄物産	12,200	5,410.00	66,002,000

泉州電業	4,500	5,480.00	24,660,000
トラスコ中山	37,400	1,966.00	73,528,400
オートバックスセブン	62,100	1,428.00	88,678,800
モリト	13,200	721.00	9,517,200
加藤産業	21,600	3,425.00	73,980,000
北恵	4,500	787.00	3,541,500
イノテック	12,100	1,364.00	16,504,400
イエローハット	31,500	1,828.00	57,582,000
J Kホールディングス	14,100	1,032.00	14,551,200
日伝	13,600	1,892.00	25,731,200
北沢産業	10,700	209.00	2,236,300
杉本商事	9,400	1,991.00	18,715,400
因幡電機産業	49,800	2,748.00	136,850,400
東テク	6,000	3,600.00	21,600,000
ミスミグループ本社	250,900	3,440.00	863,096,000
アルテック	11,100	331.00	3,674,100
タキヒヨー	5,400	788.00	4,255,200
蔵王産業	3,900	1,792.00	6,988,800
スズケン	71,600	3,315.00	237,354,000
ジェコス	13,800	810.00	11,178,000
グローセル	21,700	414.00	8,983,800
ローソン	44,300	4,680.00	207,324,000
サンエー	13,700	4,225.00	57,882,500
カワチ薬品	15,700	2,128.00	33,409,600
エービーシー・マート	31,300	5,590.00	174,967,000
ハードオフコーポレーション	9,100	1,189.00	10,819,900
アスクル	43,200	1,780.00	76,896,000
ゲオホールディングス	24,300	1,623.00	39,438,900
アダストリア	21,700	1,962.00	42,575,400
くら寿司	21,000	3,275.00	68,775,000
キャンドゥ	6,500	2,171.00	14,111,500
アイケイ	7,100	447.00	3,173,700
パルグループホールディングス	17,600	2,348.00	41,324,800
エディオン	92,000	1,208.00	111,136,000
サーラコーポレーション	37,900	832.00	31,532,800
ワッツ	10,100	740.00	7,474,000
ハローズ	9,200	3,135.00	28,842,000
フジオフードグループ本社	14,800	1,312.00	19,417,600
あみやき亭	4,900	2,904.00	14,229,600
大黒天物産	6,400	5,730.00	36,672,000
ハニーズホールディングス	16,100	1,234.00	19,867,400
ファーマライズホールディングス	4,800	683.00	3,278,400

アルペン	14,900	2,141.00	31,900,900
ハブ	7,100	562.00	3,990,200
クオールホールディングス	24,800	1,250.00	31,000,000
ジーンズホールディングス	10,700	4,250.00	45,475,000
ビックカメラ	118,800	1,144.00	135,907,200
D C Mホールディングス	119,000	1,037.00	123,403,000
M o n o t a R O	252,800	2,510.00	634,528,000
東京一番フーズ	5,100	588.00	2,998,800
きちりホールディングス	5,300	358.00	1,897,400
アークランドサービスホールディングス	14,800	2,075.00	30,710,000
J . フロント リテイリング	221,900	1,090.00	241,871,000
ドトール・日レスホールディングス	31,800	1,613.00	51,293,400
マツキヨココカラ&カンパニー	117,100	5,440.00	637,024,000
ブロンコビリー	9,600	2,383.00	22,876,800
Z O Z O	137,500	3,080.00	423,500,000
トレジャー・ファクトリー	6,100	1,689.00	10,302,900
物語コーポレーション	10,000	7,010.00	70,100,000
三越伊勢丹ホールディングス	300,300	1,051.00	315,615,300
H a m e e	7,500	1,092.00	8,190,000
マーケットエンタープライズ	2,400	891.00	2,138,400
ウエルシアホールディングス	105,800	2,953.00	312,427,400
クリエイティブSDホールディングス	29,600	3,125.00	92,500,000
丸善C H I ホールディングス	24,300	363.00	8,820,900
ミサワ	4,600	604.00	2,778,400
ティーライフ	3,000	1,303.00	3,909,000
チムニー	6,100	1,212.00	7,393,200
シュッピン	16,700	1,232.00	20,574,400
オイシックス・ラ・大地	28,900	1,917.00	55,401,300
ネクステージ	40,700	3,045.00	123,931,500
ジョイフル本田	57,500	1,706.00	98,095,000
鳥貴族ホールディングス	6,700	2,156.00	14,445,200
ホットランド	13,900	1,312.00	18,236,800
すかいらーくホールディングス	243,900	1,528.00	372,679,200
S F Pホールディングス	9,700	1,767.00	17,139,900
綿半ホールディングス	14,000	1,431.00	20,034,000
ヨシックスホールディングス	4,100	2,299.00	9,425,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	58,400	1,071.00	62,546,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,300	2,166.00	17,977,800
B E E N O S	10,200	2,398.00	24,459,600
あさひ	16,800	1,322.00	22,209,600
日本調剤	12,400	1,356.00	16,814,400
コスモス薬品	20,200	14,740.00	297,748,000

トーエル	9,100	844.00	7,680,400
セブン&アイ・ホールディングス	670,100	5,621.00	3,766,632,100
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	134,100	945.00	126,724,500
ツルハホールディングス	43,700	7,730.00	337,801,000
サンマルクホールディングス	16,000	1,621.00	25,936,000
フェリシモ	4,800	1,073.00	5,150,400
トリドールホールディングス	49,900	2,925.00	145,957,500
TOKYO BASE	19,400	344.00	6,673,600
ウイルプラスホールディングス	4,100	1,043.00	4,276,300
JMホールディングス	15,400	1,570.00	24,178,000
サツドラホールディングス	9,500	639.00	6,070,500
アレンザホールディングス	13,700	1,025.00	14,042,500
串カツ田中ホールディングス	4,900	1,872.00	9,172,800
パロックジャパンリミテッド	14,300	812.00	11,611,600
クスリのアオキホールディングス	17,900	6,080.00	108,832,000
力の源ホールディングス	10,600	649.00	6,879,400
FOOD & LIFE COMPANIES	102,500	2,366.00	242,515,000
メディカルシステムネットワーク	18,200	431.00	7,844,200
はるやまホールディングス	10,200	434.00	4,426,800
ノジマ	32,400	2,826.00	91,562,400
カップ・クリエイト	28,000	1,419.00	39,732,000
ライトオン	14,900	723.00	10,772,700
良品計画	230,200	1,286.00	296,037,200
パリミキホールディングス	26,100	250.00	6,525,000
アドヴァングループ	17,400	822.00	14,302,800
アルビス	6,000	2,301.00	13,806,000
コナカ	21,600	350.00	7,560,000
ハウス オブ ローゼ	2,700	1,640.00	4,428,000
G-7ホールディングス	22,400	1,474.00	33,017,600
イオン北海道	26,500	1,146.00	30,369,000
コジマ	34,900	659.00	22,999,100
ヒマラヤ	6,600	999.00	6,593,400
コーナン商事	28,500	3,540.00	100,890,000
エコス	6,800	1,884.00	12,811,200
ワタミ	24,200	930.00	22,506,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	399,700	2,431.00	971,670,700
西松屋チェーン	39,700	1,627.00	64,591,900
ゼンショーホールディングス	97,700	3,585.00	350,254,500
幸楽苑ホールディングス	11,600	1,140.00	13,224,000
ハークスレイ	9,000	504.00	4,536,000

サイゼリヤ	29,800	2,565.00	76,437,000
V Tホールディングス	75,900	478.00	36,280,200
魚力	5,700	2,415.00	13,765,500
フジ・コーポレーション	10,900	1,241.00	13,526,900
ユナイテッドアローズ	21,100	1,802.00	38,022,200
ハイデイ日高	29,000	2,104.00	61,016,000
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	13,500	204.00	2,754,000
コロワイド	82,100	1,894.00	155,497,400
ピーシーデポコーポレーション	24,400	284.00	6,929,600
壱番屋	14,200	4,605.00	65,391,000
P L A N T	5,100	658.00	3,355,800
スギホールディングス	40,000	5,980.00	239,200,000
薬王堂ホールディングス	10,100	2,314.00	23,371,400
スクロール	31,200	784.00	24,460,800
ヨンドシーホールディングス	17,100	1,825.00	31,207,500
木曽路	27,100	2,186.00	59,240,600
S R S ホールディングス	29,500	863.00	25,458,500
千趣会	33,700	389.00	13,109,300
リテールパートナーズ	26,700	1,119.00	29,877,300
ケーヨー	37,100	927.00	34,391,700
上新電機	19,600	1,947.00	38,161,200
日本瓦斯	95,700	2,215.00	211,975,500
ロイヤルホールディングス	34,000	2,171.00	73,814,000
いなげや	20,000	1,245.00	24,900,000
チヨダ	17,500	805.00	14,087,500
ライフコーポレーション	15,700	2,639.00	41,432,300
リンガーハット	23,000	2,251.00	51,773,000
M r M a x H D	25,500	627.00	15,988,500
A O K I ホールディングス	39,200	683.00	26,773,600
オークワ	28,700	906.00	26,002,200
コメリ	31,000	2,626.00	81,406,000
青山商事	38,500	882.00	33,957,000
しまむら	23,300	12,590.00	293,347,000
はせがわ	11,700	371.00	4,340,700
高島屋	134,500	1,524.00	204,978,000
松屋	33,800	847.00	28,628,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	87,000	941.00	81,867,000
近鉄百貨店	5,900	2,261.00	13,339,900
丸井グループ	144,700	2,445.00	353,791,500
アクシアル リテイリング	13,400	3,435.00	46,029,000
イオン	659,200	2,707.50	1,784,784,000
イズミ	31,700	2,980.00	94,466,000

平和堂	29,900	1,983.00	59,291,700
フジ	43,900	1,967.00	86,351,300
ヤオコー	22,700	6,510.00	147,777,000
ゼビオホールディングス	27,500	969.00	26,647,500
ケーズホールディングス	170,400	1,284.00	218,793,600
Olympicグループ	9,400	597.00	5,611,800
日産東京販売ホールディングス	30,800	294.00	9,055,200
シルバーライフ	4,400	1,312.00	5,772,800
Genky DrugStores	8,900	3,600.00	32,040,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,900	854.00	4,184,600
ブックオフグループホールディングス	12,000	1,011.00	12,132,000
ギフトホールディングス	3,900	3,000.00	11,700,000
アインホールディングス	24,600	7,880.00	193,848,000
元気寿司	5,700	2,542.00	14,489,400
ヤマダホールディングス	707,700	477.00	337,572,900
アークランドサカモト	31,500	1,521.00	47,911,500
ニトリホールディングス	79,300	13,040.00	1,034,072,000
グルメ杵屋	16,200	1,030.00	16,686,000
愛眼	14,600	178.00	2,598,800
ケーユーホールディングス	10,700	1,218.00	13,032,600
吉野家ホールディングス	69,900	2,465.00	172,303,500
松屋フーズホールディングス	9,700	3,825.00	37,102,500
サガミホールディングス	28,900	1,196.00	34,564,400
関西フードマーケット	16,400	1,215.00	19,926,000
王将フードサービス	13,300	6,510.00	86,583,000
プレナス	22,600	1,934.00	43,708,400
ミニストップ	14,900	1,456.00	21,694,400
アークス	35,600	2,080.00	74,048,000
パローホールディングス	41,000	1,798.00	73,718,000
ベルク	8,900	5,470.00	48,683,000
大庄	11,000	1,164.00	12,804,000
ファーストリテイリング	26,700	82,550.00	2,204,085,000
サンドラッグ	75,300	3,440.00	259,032,000
サクスパー ホールディングス	19,400	615.00	11,931,000
ヤマザワ	4,400	1,381.00	6,076,400
やまや	4,200	2,590.00	10,878,000
ベルーナ	43,400	742.00	32,202,800
島根銀行	6,400	476.00	3,046,400
じもとホールディングス	13,200	555.00	7,326,000
めぶきフィナンシャルグループ	823,200	265.00	218,148,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	23,200	2,254.00	52,292,800
九州フィナンシャルグループ	350,300	383.00	134,164,900



ゆうちょ銀行	472,400	1,009.00	476,651,600
富山第一銀行	44,500	423.00	18,823,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	990,500	444.00	439,782,000
西日本フィナンシャルホールディングス	105,000	755.00	79,275,000
三十三フィナンシャルグループ	16,100	1,470.00	23,667,000
第四北越フィナンシャルグループ	28,200	2,593.00	73,122,600
ひろぎんホールディングス	255,800	618.00	158,084,400
おきなわフィナンシャルグループ	16,900	2,182.00	36,875,800
十六フィナンシャルグループ	23,300	2,468.00	57,504,400
北國フィナンシャルホールディングス	16,500	4,935.00	81,427,500
プロクレアホールディングス	20,300	2,176.00	44,172,800
新生銀行	130,500	1,953.00	254,866,500
あおぞら銀行	111,800	2,693.00	301,077,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,713,200	725.10	8,493,241,320
りそなホールディングス	2,117,400	514.40	1,089,190,560
三井住友トラスト・ホールディングス	331,000	4,356.00	1,441,836,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,298,600	4,189.00	5,439,835,400
千葉銀行	565,100	752.00	424,955,200
群馬銀行	321,900	394.00	126,828,600
武蔵野銀行	25,600	1,710.00	43,776,000
千葉興業銀行	43,100	261.00	11,249,100
筑波銀行	78,000	196.00	15,288,000
七十七銀行	53,100	1,771.00	94,040,100
秋田銀行	12,000	1,656.00	19,872,000
山形銀行	18,400	942.00	17,332,800
岩手銀行	12,200	1,893.00	23,094,600
東邦銀行	143,100	206.00	29,478,600
東北銀行	9,000	972.00	8,748,000
ふくおかフィナンシャルグループ	144,500	2,471.00	357,059,500
静岡銀行	412,400	814.00	335,693,600
スルガ銀行	175,500	384.00	67,392,000
八十二銀行	371,200	491.00	182,259,200
山梨中央銀行	20,100	1,158.00	23,275,800
大垣共立銀行	34,300	1,733.00	59,441,900
福井銀行	16,000	1,403.00	22,448,000
清水銀行	7,100	1,496.00	10,621,600
富山銀行	3,100	1,774.00	5,499,400
滋賀銀行	32,600	2,598.00	84,694,800
南都銀行	27,000	1,976.00	53,352,000
百五銀行	168,100	321.00	53,960,100
京都銀行	62,100	5,460.00	339,066,000
紀陽銀行	59,400	1,476.00	87,674,400

ほくほくフィナンシャルグループ	113,600	838.00	95,196,800
山陰合同銀行	111,200	683.00	75,949,600
中国銀行	140,800	953.00	134,182,400
鳥取銀行	6,400	1,124.00	7,193,600
伊予銀行	224,300	656.00	147,140,800
百十四銀行	18,400	1,701.00	31,298,400
四国銀行	26,300	853.00	22,433,900
阿波銀行	26,600	1,928.00	51,284,800
大分銀行	10,700	1,905.00	20,383,500
宮崎銀行	10,800	2,206.00	23,824,800
佐賀銀行	10,500	1,493.00	15,676,500
琉球銀行	43,400	777.00	33,721,800
セブン銀行	594,300	264.00	156,895,200
みずほフィナンシャルグループ	2,399,300	1,584.50	3,801,690,850
高知銀行	6,300	677.00	4,265,100
山口フィナンシャルグループ	199,800	767.00	153,246,600
長野銀行	6,100	1,282.00	7,820,200
名古屋銀行	12,200	3,115.00	38,003,000
北洋銀行	251,400	230.00	57,822,000
愛知銀行	6,200	5,820.00	36,084,000
中京銀行	6,200	1,863.00	11,550,600
大光銀行	5,900	1,348.00	7,953,200
愛媛銀行	26,100	859.00	22,419,900
トマト銀行	6,100	1,027.00	6,264,700
京葉銀行	83,500	486.00	40,581,000
栃木銀行	89,800	288.00	25,862,400
北日本銀行	5,800	1,661.00	9,633,800
東和銀行	32,800	527.00	17,285,600
福島銀行	21,200	219.00	4,642,800
大東銀行	8,800	638.00	5,614,400
トモニホールディングス	144,400	314.00	45,341,600
フィデアホールディングス	18,300	1,331.00	24,357,300
池田泉州ホールディングス	212,400	220.00	46,728,000
F P G	67,600	1,247.00	84,297,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,700	1,336.00	18,303,200
マーキュリアホールディングス	11,200	613.00	6,865,600
S B Iホールディングス	247,300	2,729.00	674,881,700
ジャフコ グループ	69,400	1,989.00	138,036,600
大和証券グループ本社	1,285,600	606.40	779,587,840
野村ホールディングス	3,055,800	501.20	1,531,566,960
岡三証券グループ	145,000	334.00	48,430,000
丸三証券	60,000	479.00	28,740,000

東洋証券	61,600	259.00	15,954,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	197,700	378.00	74,730,600
光世証券	4,800	448.00	2,150,400
水戸証券	50,000	268.00	13,400,000
いちよし証券	33,500	629.00	21,071,500
松井証券	98,300	796.00	78,246,800
マネックスグループ	169,000	483.00	81,627,000
極東証券	23,100	695.00	16,054,500
岩井コスモホールディングス	19,100	1,258.00	24,027,800
アイザワ証券グループ	27,300	646.00	17,635,800
マネーパートナーズグループ	22,300	248.00	5,530,400
スパークス・グループ	93,300	300.00	27,990,000
かんぽ生命保険	201,400	2,109.00	424,752,600
S O M P Oホールディングス	284,700	5,874.00	1,672,327,800
アニコム ホールディングス	61,500	650.00	39,975,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	411,400	4,135.00	1,701,139,000
第一生命ホールディングス	974,500	2,359.00	2,298,845,500
東京海上ホールディングス	556,800	7,550.00	4,203,840,000
T & Dホールディングス	445,200	1,472.00	655,334,400
アドバンスクリエイト	9,600	1,077.00	10,339,200
全国保証	47,900	4,585.00	219,621,500
あんしん保証	10,000	263.00	2,630,000
イントラスト	9,400	657.00	6,175,800
日本モーゲージサービス	11,700	947.00	11,079,900
C a s a	7,700	853.00	6,568,100
アルヒ	30,100	1,050.00	31,605,000
プレミアグループ	10,300	5,210.00	53,663,000
ネットプロテクションズホールディングス	61,700	510.00	31,467,000
クレディセゾン	117,200	1,763.00	206,623,600
芙蓉総合リース	17,300	8,190.00	141,687,000
みずほリース	24,900	3,380.00	84,162,000
東京センチュリー	31,100	4,930.00	153,323,000
日本証券金融	79,400	833.00	66,140,200
アイフル	337,500	386.00	130,275,000
リコーリース	17,900	3,615.00	64,708,500
イオンフィナンシャルサービス	109,300	1,440.00	157,392,000
アコム	396,700	332.00	131,704,400
ジャックス	20,100	3,845.00	77,284,500
オリエントコーポレーション	546,100	123.00	67,170,300
オリックス	1,189,200	2,260.00	2,687,592,000
三菱HCキャピタル	647,800	668.00	432,730,400
九州リースサービス	9,500	622.00	5,909,000

日本取引所グループ	466,400	2,072.00	966,380,800
イー・ギャランティ	30,000	2,275.00	68,250,000
アサックス	11,300	600.00	6,780,000
NECキャピタルソリューション	8,400	2,131.00	17,900,400
いちご	229,400	302.00	69,278,800
日本駐車場開発	209,100	158.00	33,037,800
スター・マイカ・ホールディングス	9,700	1,562.00	15,151,400
SREホールディングス	5,800	2,877.00	16,686,600
ADワークスグループ	44,600	157.00	7,002,200
ヒューリック	389,000	1,055.00	410,395,000
三栄建築設計	9,200	1,665.00	15,318,000
野村不動産ホールディングス	104,200	3,365.00	350,633,000
三重交通グループホールディングス	44,500	480.00	21,360,000
サムティ	27,300	2,188.00	59,732,400
ディア・ライフ	27,800	657.00	18,264,600
地主	13,600	2,010.00	27,336,000
プレサンスコーポレーション	23,000	1,512.00	34,776,000
ハウスコム	5,500	942.00	5,181,000
JPMC	10,200	1,001.00	10,210,200
サンセイランディック	7,600	829.00	6,300,400
フージャースホールディングス	25,600	805.00	20,608,000
オープンハウスグループ	64,000	5,310.00	339,840,000
東急不動産ホールディングス	547,000	738.00	403,686,000
飯田グループホールディングス	164,400	2,153.00	353,953,200
イーランド	4,100	1,509.00	6,186,900
ムゲンエステート	16,200	478.00	7,743,600
And Doホールディングス	9,900	865.00	8,563,500
シーアールイー	8,700	1,702.00	14,807,400
ケイアイスター不動産	9,400	4,890.00	45,966,000
グッドコムアセット	9,200	1,320.00	12,144,000
ジェイ・エス・ビー	4,700	3,450.00	16,215,000
ロードスターキャピタル	8,100	1,829.00	14,814,900
テンポイノベーション	7,700	914.00	7,037,800
フェイスネットワーク	3,900	1,408.00	5,491,200
パーク24	130,400	1,922.00	250,628,800
バラカ	6,800	1,990.00	13,532,000
三井不動産	781,600	2,798.50	2,187,307,600
三菱地所	1,140,600	1,866.50	2,128,929,900
平和不動産	32,300	3,970.00	128,231,000
東京建物	159,100	2,137.00	339,996,700
京阪神ビルディング	27,600	1,251.00	34,527,600
住友不動産	360,500	3,397.00	1,224,618,500

テーオーシー	32,400	728.00	23,587,200
東京楽天地	3,300	4,060.00	13,398,000
スターツコーポレーション	27,900	2,663.00	74,297,700
フジ住宅	26,100	656.00	17,121,600
空港施設	23,400	552.00	12,916,800
明和地所	12,400	617.00	7,650,800
ゴールドクレスト	16,900	1,751.00	29,591,900
エスリード	8,900	1,716.00	15,272,400
日神グループホールディングス	36,800	431.00	15,860,800
日本エスコン	37,300	798.00	29,765,400
タカラレーベン	83,800	378.00	31,676,400
A V A N T I A	11,700	830.00	9,711,000
イオンモール	101,600	1,676.00	170,281,600
毎日コムネット	9,800	618.00	6,056,400
ファースト住建	9,100	1,134.00	10,319,400
カチタス	50,200	3,260.00	163,652,000
トーセイ	29,100	1,376.00	40,041,600
穴吹興産	5,300	2,082.00	11,034,600
サンフロンティア不動産	29,400	1,194.00	35,103,600
F Jネクストホールディングス	21,400	1,035.00	22,149,000
インテリックス	4,500	558.00	2,511,000
ランドビジネス	6,700	243.00	1,628,100
サンネクスタグループ	8,000	972.00	7,776,000
グランディハウス	16,900	546.00	9,227,400
日本空港ビルデング	64,900	5,560.00	360,844,000
明豊ファシリティワークス	9,400	670.00	6,298,000
日本工営	12,400	3,570.00	44,268,000
L I F U L L	61,300	173.00	10,604,900
ミクシィ	44,500	2,333.00	103,818,500
ジェイエイシーリクルートメント	15,800	1,962.00	30,999,600
日本M & Aセンターホールディングス	318,200	1,719.00	546,985,800
メンバーズ	5,200	2,506.00	13,031,200
中広	4,000	407.00	1,628,000
UTグループ	28,100	2,766.00	77,724,600
アイティメディア	9,400	1,742.00	16,374,800
E・Jホールディングス	11,400	1,292.00	14,728,800
夢真ビーネックスグループ	63,500	1,635.00	103,822,500
コシダカホールディングス	52,300	815.00	42,624,500
アルトナー	5,100	936.00	4,773,600
パソナグループ	21,200	2,043.00	43,311,600
C D S	5,000	1,780.00	8,900,000
リンクアンドモチベーション	49,900	618.00	30,838,200

エス・エム・エス	66,000	3,125.00	206,250,000
サニーサイドアップグループ	7,200	631.00	4,543,200
パーソルホールディングス	194,000	2,732.00	530,008,000
リニカル	11,300	731.00	8,260,300
クックパッド	49,000	220.00	10,780,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	10,000	596.00	5,960,000
学情	8,200	1,132.00	9,282,400
スタジオアリス	8,800	2,267.00	19,949,600
シミックホールディングス	9,800	1,623.00	15,905,400
エプロ	4,600	650.00	2,990,000
N J S	4,000	2,038.00	8,152,000
総合警備保障	70,800	3,585.00	253,818,000
カカクコム	142,400	2,499.00	355,857,600
アイロムグループ	7,100	2,440.00	17,324,000
セントケア・ホールディング	13,000	872.00	11,336,000
サイネックス	3,900	595.00	2,320,500
ルネサンス	13,900	959.00	13,330,100
ディップ	34,200	3,610.00	123,462,000
デジタルホールディングス	13,800	1,306.00	18,022,800
新日本科学	23,800	2,291.00	54,525,800
キャリアデザインセンター	4,200	1,672.00	7,022,400
ベネフィット・ワン	70,400	2,017.00	141,996,800
エムスリー	342,200	4,461.00	1,526,554,200
ツカダ・グローバルホールディング	12,300	332.00	4,083,600
アウトソーシング	103,500	1,202.00	124,407,000
ウェルネット	17,900	492.00	8,806,800
ワールドホールディングス	7,900	2,713.00	21,432,700
ディー・エヌ・エー	74,000	1,903.00	140,822,000
博報堂D Yホールディングス	245,700	1,246.00	306,142,200
ぐるなび	29,100	430.00	12,513,000
タカミヤ	24,300	424.00	10,303,200
ジャパンベストレスキューシステム	10,900	747.00	8,142,300
ファンコミュニケーションズ	34,800	411.00	14,302,800
ライク	6,600	2,224.00	14,678,400
ビジネス・ブレークスルー	8,000	415.00	3,320,000
エスプール	50,100	1,089.00	54,558,900
W D Bホールディングス	9,000	2,509.00	22,581,000
ティア	12,100	439.00	5,311,900
C D G	2,300	1,272.00	2,925,600
アドウェイズ	24,300	751.00	18,249,300
バリューコマース	13,200	2,522.00	33,290,400
インフォマート	180,600	414.00	74,768,400

J Pホールディングス	51,200	252.00	12,902,400
エコナックホールディングス	37,300	88.00	3,282,400
C Lホールディングス	5,200	846.00	4,399,200
プレステージ・インターナショナル	73,200	636.00	46,555,200
アミューズ	10,700	1,933.00	20,683,100
ドリームインキュベータ	6,100	1,998.00	12,187,800
クイック	12,300	1,694.00	20,836,200
T A C	12,200	227.00	2,769,400
電通グループ	181,800	4,465.00	811,737,000
イオンファンタジー	7,600	3,375.00	25,650,000
シーティーエス	22,300	782.00	17,438,600
ネクシィーズグループ	6,600	571.00	3,768,600
H . U . グループホールディングス	50,800	2,907.00	147,675,600
アルプス技研	15,300	1,877.00	28,718,100
ダイオーズ	4,100	1,293.00	5,301,300
日本空調サービス	20,800	758.00	15,766,400
オリエンタルランド	206,200	20,100.00	4,144,620,000
ダスキン	41,900	2,874.00	120,420,600
明光ネットワークジャパン	23,400	614.00	14,367,600
ファルコホールディングス	8,700	1,833.00	15,947,100
ラウンドワン	54,300	1,976.00	107,296,800
リゾートトラスト	82,200	2,220.00	182,484,000
ビー・エム・エル	24,800	3,575.00	88,660,000
りらいあコミュニケーションズ	28,900	1,013.00	29,275,700
リソー教育	89,800	310.00	27,838,000
早稲田アカデミー	11,100	1,085.00	12,043,500
ユー・エス・エス	217,200	2,444.00	530,836,800
東京個別指導学院	17,700	576.00	10,195,200
サイバーエージェント	414,400	1,343.00	556,539,200
楽天グループ	800,500	667.00	533,933,500
クリーク・アンド・リバー社	10,300	2,434.00	25,070,200
モーニングスター	34,600	491.00	16,988,600
テー・オー・ダブリュー	38,200	307.00	11,727,400
山田コンサルティンググループ	10,300	1,248.00	12,854,400
セントラルスポーツ	7,400	2,511.00	18,581,400
フルキャストホールディングス	16,700	2,394.00	39,979,800
エン・ジャパン	34,600	2,310.00	79,926,000
リソルホールディングス	2,200	4,570.00	10,054,000
テクノプロ・ホールディングス	116,200	3,195.00	371,259,000
アトラグループ	4,300	189.00	812,700
インターワークス	6,500	403.00	2,619,500
アイ・アールジャパンホールディングス	9,100	2,239.00	20,374,900

KeepEr 技研	12,600	3,940.00	49,644,000
ファーストロジック	3,500	780.00	2,730,000
三機サービス	3,700	965.00	3,570,500
Gunosy	11,100	747.00	8,291,700
デザインワン・ジャパン	7,700	180.00	1,386,000
イー・ガーディアン	6,700	2,983.00	19,986,100
リブセンス	10,000	276.00	2,760,000
ジャパンマテリアル	59,800	1,972.00	117,925,600
ベクトル	27,500	1,158.00	31,845,000
ウチヤマホールディングス	10,700	298.00	3,188,600
チャーム・ケア・コーポレーション	14,700	1,164.00	17,110,800
キャリアリンク	7,300	2,321.00	16,943,300
I B J	11,000	927.00	10,197,000
アサンテ	8,800	1,637.00	14,405,600
バリューHR	15,400	1,441.00	22,191,400
M&Aキャピタルパートナーズ	16,100	3,240.00	52,164,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,800	1,215.00	9,477,000
E R Iホールディングス	5,800	1,009.00	5,852,200
アビスト	3,100	3,080.00	9,548,000
シグマクシス・ホールディングス	23,600	1,237.00	29,193,200
ウィルグループ	14,700	1,355.00	19,918,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	22,400	157.00	3,516,800
メドピア	13,800	1,623.00	22,397,400
レアジョブ	4,200	733.00	3,078,600
リクルートホールディングス	1,388,900	4,397.00	6,106,993,300
エラン	23,200	1,102.00	25,566,400
土木管理総合試験所	9,200	319.00	2,934,800
ネットマーケティング	9,900	897.00	8,880,300
日本郵政	2,118,500	954.60	2,022,320,100
ベルシステム24ホールディングス	28,100	1,473.00	41,391,300
鎌倉新書	22,600	656.00	14,825,600
S M N	5,000	560.00	2,800,000
グローバルキッズCOMPANY	3,500	691.00	2,418,500
エアトリ	11,300	2,639.00	29,820,700
アトラエ	13,800	1,646.00	22,714,800
ストライク	8,600	3,850.00	33,110,000
ソラスト	48,100	829.00	39,874,900
セラク	6,400	1,101.00	7,046,400
インソース	21,600	2,759.00	59,594,400
ベйкаレント・コンサルティング	13,700	40,700.00	557,590,000
Orchestra Holdings	3,800	2,643.00	10,043,400
アイモバイル	9,900	1,391.00	13,770,900



キャリアインデックス	7,300	445.00	3,248,500
MS - J a p a n	8,300	782.00	6,490,600
船場	3,800	745.00	2,831,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	61,700	1,815.00	111,985,500
フルテック	3,000	1,234.00	3,702,000
GameWith	6,600	391.00	2,580,600
MS&Consulting	3,400	619.00	2,104,600
ウェルビー	13,200	733.00	9,675,600
エル・ティー・エス	2,300	3,160.00	7,268,000
ミダックホールディングス	8,900	3,050.00	27,145,000
日総工産	15,700	575.00	9,027,500
キュービーネットホールディングス	9,200	1,387.00	12,760,400
RPAホールディングス	28,500	314.00	8,949,000
スプリックス	7,000	1,087.00	7,609,000
マネジメントソリューションズ	9,600	2,945.00	28,272,000
プロレド・パートナーズ	4,900	517.00	2,533,300
テノ・ホールディングス	2,900	594.00	1,722,600
フロンティア・マネジメント	6,000	1,388.00	8,328,000
ピアラ	3,600	735.00	2,646,000
コプロ・ホールディングス	4,200	929.00	3,901,800
ギークス	3,700	905.00	3,348,500
カーブスホールディングス	53,700	801.00	43,013,700
フォーラムエンジニアリング	12,200	966.00	11,785,200
Fast Fitness Japan	3,800	1,473.00	5,597,400
ダイレクトマーケティングミックス	19,900	1,825.00	36,317,500
ポピンズ	2,800	1,843.00	5,160,400
LITALICO	15,800	2,855.00	45,109,000
アドバンテッジリスクマネジメント	10,500	487.00	5,113,500
リログループ	106,200	2,190.00	232,578,000
東祥	14,800	1,153.00	17,064,400
ビーウィズ	5,400	1,395.00	7,533,000
TREホールディングス	36,700	1,685.00	61,839,500
人・夢・技術グループ	7,900	2,645.00	20,895,500
エイチ・アイ・エス	45,500	2,057.00	93,593,500
ラックランド	5,500	2,951.00	16,230,500
共立メンテナンス	34,700	5,250.00	182,175,000
イチネンホールディングス	20,200	1,255.00	25,351,000
建設技術研究所	9,100	2,583.00	23,505,300
スペース	13,000	853.00	11,089,000
燦ホールディングス	8,600	1,797.00	15,454,200
スバル興業	1,200	8,870.00	10,644,000
東京テアトル	7,100	1,214.00	8,619,400

タナベ経営	8,000	645.00	5,160,000	
ナガワ	5,500	8,010.00	44,055,000	
東京都競馬	14,600	4,205.00	61,393,000	
カナモト	31,900	2,135.00	68,106,500	
西尾レントオール	16,200	2,856.00	46,267,200	
トランス・コスモス	24,700	3,650.00	90,155,000	
乃村工藝社	83,500	931.00	77,738,500	
藤田観光	7,700	2,696.00	20,759,200	
KNT-CTホールディングス	12,100	1,684.00	20,376,400	
日本管財	20,900	2,651.00	55,405,900	
トーカイ	15,500	1,813.00	28,101,500	
セコム	191,100	8,760.00	1,674,036,000	
セントラル警備保障	9,500	2,537.00	24,101,500	
丹青社	37,100	799.00	29,642,900	
メイテック	69,200	2,436.00	168,571,200	
応用地質	17,000	1,783.00	30,311,000	
船井総研ホールディングス	36,500	2,352.00	85,848,000	
進学会ホールディングス	7,400	322.00	2,382,800	
オオバ	12,600	718.00	9,046,800	
いであ	4,500	1,725.00	7,762,500	
学究社	6,400	1,606.00	10,278,400	
ベネッセホールディングス	64,800	2,177.00	141,069,600	
イオンディライト	22,500	2,872.00	64,620,000	
ナック	9,600	944.00	9,062,400	
ダイセキ	35,400	4,150.00	146,910,000	
ステップ	7,300	1,782.00	13,008,600	
合 計	205,488,400		504,544,593,870	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 8月29日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	10,695,413,549
コール・ローン	1,017,956,769
株式	532,553,614,703
投資信託受益証券	298,607,150
投資証券	13,191,501,545
派生商品評価勘定	497,817,245
未収入金	2,741,429
未収配当金	858,659,369
差入委託証拠金	3,548,408,669
流動資産合計	562,664,720,428
資産合計	562,664,720,428
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	79,360,133
前受金	409,978,950
未払解約金	194,965,538
未払利息	1,703
流動負債合計	684,306,324
負債合計	684,306,324
純資産の部	
元本等	
元本	127,813,585,667
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	434,166,828,437
元本等合計	561,980,414,104
純資産合計	561,980,414,104
負債純資産合計	562,664,720,428

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 8月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

	2022年 8月29日現在
	<p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2022年 8月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	127,813,585,667口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.3969円 (43,969円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

2022年 8月29日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月29日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2022年 8月29日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	133,977,978,789円
期中追加設定元本額	17,028,831,619円
期中一部解約元本額	23,193,224,741円
期末元本額	127,813,585,667円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,874,921,758円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,539,705円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	32,452,522,155円
世界経済インデックスファンド	11,114,926,446円
外国株式インデックス・オープン	886,305,095円
D C マイセレクション 2 5	798,746,038円
D C マイセレクション 5 0	3,650,489,537円
D C マイセレクション 7 5	4,381,672,820円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,971,580,419円

区分	2022年 8月29日現在
DCマイセレクションS25	405,418,931円
DCマイセレクションS50	1,861,389,519円
DCマイセレクションS75	1,585,679,786円
DCターゲット・イヤーフンド2025	35,498,423円
DCターゲット・イヤーフンド2035	149,394,516円
DCターゲット・イヤーフンド2045	111,166,105円
DC世界経済インデックスファンド	9,939,522,792円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,395,868,567円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,617,563円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	4,723,159円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	26,266,318円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	12,318,823円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	50,530,039円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	11,368,951円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	31,477,956円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	261,872,034円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	169,393,045円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,242,072,986円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	104,489,403円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	24,375,793円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	158,446,855円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	52,543,813円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	989,546,670円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,089,982,275円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,135,745,517円
コア投資戦略ファンド（安定型）	560,233,098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	8,213,245,075円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,329,977,197円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,116,285,606円
コア投資戦略ファンド（切替型）	598,401,219円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	581,827,888円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,161,428円
SMT インデックスバランス・オープン	157,558,804円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	362,459,872円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	17,148,575,159円
SMT 世界経済インデックス・オープン	203,028,774円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	781,637,957円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	143,092,650円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,067,333円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	220,858,020円
グローバル経済コア	644,569,689円

区分	2022年 8月29日現在
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A 対応型）	13,815,903円
D C ターゲット・イヤー ファンド2 0 5 5	5,311,840円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	472,763,498円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	80,500,147円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 3 0	47,783,273円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 4 0	39,946,205円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 5 0	15,200,930円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 6 0	21,859,038円
1 0 資産分散投資ファンド	18,092円
F O F s 用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	263,272,399円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	31,761,258円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	892,368,551円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,295,260,634円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	214,059,209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）	66,702,080円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	66,662,894円
S M T A M 海外バランスファンド2 0 2 0 - 0 1（適格機関投資家専用）	236,402,277円
S M T A M 海外バランスファンド2 0 2 0 - 0 8（適格機関投資家専用）	226,303,448円
S M T A M 海外バランスファンド2 0 2 0 - 1 1（適格機関投資家専用）	225,149,556円
S M T A M 海外バランスファンド2 0 2 1 - 0 4（適格機関投資家専用）	228,989,512円
S M T A M 海外バランスファンド2 0 2 1 - 0 7（適格機関投資家専用）	225,426,645円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2 0 2 1 - 1 1（適格機関投資家専用）	112,167,658円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 8月29日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	14,769,136,160
投資信託受益証券	6,700,158
投資証券	601,326,009
合計	15,377,162,327

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2022年 8月29日現在）



区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	15,834,895,943	-	16,244,874,893	409,978,950
	合計	15,834,895,943	-	16,244,874,893	409,978,950

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2022年 8月29日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,166,496,665	-	1,174,974,827	8,478,162
	アメリカドル	942,157,000	-	949,613,250	7,456,250
	カナダドル	13,764,270	-	13,763,347	923
	ユーロ	103,818,260	-	104,392,274	574,014
	イギリスポンド	50,055,935	-	50,085,956	30,021
	スイスフラン	56,701,200	-	57,120,000	418,800
	合計	1,166,496,665	-	1,174,974,827	8,478,162

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	27,671	40.18	1,111,820.78	
	BAKER HUGHES CO	75,948	26.13	1,984,521.24	

CHENIERE ENERGY INC	18,243	167.76	3,060,445.68
CHEVRON CORP	158,183	163.41	25,848,684.03
CONOCOPHILLIPS	105,873	112.12	11,870,480.76
COTERRA ENERGY INC	64,000	30.87	1,975,680.00
DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	72.77	3,657,129.12
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	133.93	1,776,849.31
EOG RESOURCES INC	47,936	124.57	5,971,387.52
EQT CORPORATION	27,026	49.67	1,342,381.42
EXXON MOBIL	343,717	97.87	33,639,582.79
HALLIBURTON CO	71,583	31.10	2,226,231.30
HESS CORP	22,781	124.60	2,838,512.60
KINDER MORGAN INC	168,208	18.99	3,194,269.92
MARATHON OIL CORP	57,281	26.16	1,498,470.96
MARATHON PETROLEUM CORP	45,012	104.34	4,696,552.08
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	74,379	73.55	5,470,575.45
ONEOK INC	35,533	64.84	2,303,959.72
PHILLIPS 66	38,237	92.18	3,524,686.66
PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	257.38	4,690,493.12
SCHLUMBERGER	112,526	39.42	4,435,774.92
TARGA RESOURCES CORP	17,298	70.21	1,214,492.58
VALERO ENERGY CORP	32,597	121.88	3,972,922.36
WILLIAMS COS	98,553	35.03	3,452,311.59
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	262.23	4,599,776.43
ALBEMARLE CORP	9,440	288.16	2,720,230.40
ALCOA CORP	15,500	55.84	865,520.00
AMCOR PLC	126,534	12.42	1,571,552.28
AVERY DENNISON CORP	6,638	188.78	1,253,121.64
BALL CORP	25,605	57.71	1,477,664.55
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	113.89	977,403.98
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	118.35	1,955,970.45
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	18.73	805,390.00
CORTEVA INC	58,500	62.32	3,645,720.00
CROWN HOLDINGS INC	9,940	92.12	915,672.80
DOW INC	60,585	54.46	3,299,459.10
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	57.82	2,369,463.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	95.04	1,052,568.00
ECOLAB INC	21,208	165.26	3,504,834.08
FMC CORP	10,507	113.92	1,196,957.44
FREEMPORT-MCMORAN INC	119,600	32.19	3,849,924.00
INT'L PAPER CO	30,800	42.62	1,312,696.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,024	114.22	2,401,361.28
LINDE PLC	41,706	286.25	11,938,342.50

LYONDELLBASELL INDU-CL A	21,835	86.87	1,896,806.45
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,192	351.74	1,826,234.08
MOSAIC CO/THE	27,732	61.77	1,713,005.64
NEWMONT CORPORATION	65,704	43.22	2,839,726.88
NUCOR CORP	22,299	140.51	3,133,232.49
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	138.94	1,068,031.78
PPG INDUSTRIES INC	19,278	126.04	2,429,799.12
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	94.86	991,856.16
SEALED AIR CORP	11,690	54.39	635,819.10
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	235.70	4,647,768.30
STEEL DYNAMICS INC	15,552	86.87	1,351,002.24
VULCAN MATERIALS CO	10,247	169.11	1,732,870.17
WESTLAKE CORP	4,100	106.97	438,577.00
WESTROCK CO	21,356	41.22	880,294.32
3 M COMPANY	46,618	129.14	6,020,248.52
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	45.59	501,717.95
ALLEGION PLC	7,601	97.66	742,313.66
AMETEK INC	18,006	122.66	2,208,615.96
BOEING CO	45,184	164.53	7,434,123.52
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	40.24	2,742,677.92
CATERPILLAR	43,701	191.92	8,387,095.92
CUMMINS INC	11,214	222.50	2,495,115.00
DEERE&CO	23,765	379.38	9,015,965.70
DOVER CORP	12,041	127.99	1,541,127.59
EATON CORP	32,650	141.08	4,606,262.00
EMERSON ELECTRIC CO	48,687	84.66	4,121,841.42
FASTENAL CO	44,846	50.96	2,285,352.16
FORTIVE CORP	28,348	64.74	1,835,249.52
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	62.94	648,911.40
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	234.88	1,223,959.68
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	232.59	4,412,232.30
GENERAL ELECTRIC CO	89,763	75.27	6,756,461.01
GRAINGER (WW) INC	3,667	566.24	2,076,402.08
HEICO CORP	3,640	155.89	567,439.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	126.28	814,379.72
HONEYWELL INTL INC	55,841	193.06	10,780,663.46
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	36.66	1,158,236.04
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	236.20	831,896.40
IDEX CORP	5,916	205.46	1,215,501.36
ILLINOIS TOOL WORKS	24,918	199.47	4,970,393.46
INGERSOLL-RAND INC	31,562	48.29	1,524,128.98
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	51.83	917,391.00

JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	54.61	3,095,786.29
KORNIT DIGITAL LTD	2,776	30.31	84,140.56
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	234.06	3,670,997.04
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	242.65	612,933.90
LOCKHEED MARTIN CORP	19,979	431.13	8,613,546.27
MASCO CORP	19,462	51.01	992,756.62
NORDSON CORP	4,121	232.83	959,492.43
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,122	485.13	5,880,745.86
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	75.23	2,547,137.34
OWENS CORNING	8,642	85.33	737,421.86
PACCAR INC	28,106	89.97	2,528,696.82
PARKER HANNIFIN CORP	10,579	276.20	2,921,919.80
PENTAIR PLC	14,533	46.18	671,133.94
PLUG POWER INC	41,884	28.94	1,212,122.96
QUANTA SERVICES INC	11,465	144.63	1,658,182.95
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	121,485	93.52	11,361,277.20
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	236.88	2,155,134.24
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	41.18	569,437.04
SMITH (A.O.) CORP	9,016	58.43	526,804.88
SNAP-ON INC	4,000	220.25	881,000.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	90.07	1,134,701.86
TEXTRON	16,934	64.62	1,094,275.08
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	155.57	2,899,513.66
TRANSDIGM GROUP INC	4,347	631.02	2,743,043.94
UNITED RENTALS INC	6,022	306.42	1,845,261.24
WABTEC CORP	15,024	90.44	1,358,770.56
XYLEM INC	15,077	92.97	1,401,708.69
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	96.91	1,101,285.24
CINTAS CORP	7,423	420.02	3,117,808.46
CLARIVATE PLC	27,357	12.07	330,198.99
COPART INC	16,617	122.37	2,033,422.29
COSTAR GROUP INC	32,116	70.32	2,258,397.12
EQUIFAX INC	9,509	197.13	1,874,509.17
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	127.56	1,359,917.16
LEIDOS HOLDINGS	11,220	97.20	1,090,584.00
REPUBLIC SERVICES INC	18,296	144.68	2,647,065.28
ROBERT HALF INTL INC	9,566	77.77	743,947.82
ROLLINS INC	17,468	34.48	602,296.64
TRANSUNION	15,741	77.64	1,222,131.24
VERISK ANALYTICS INC	13,315	189.89	2,528,385.35
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	139.64	2,970,841.00
WASTE MANAGEMENT INC	33,891	171.51	5,812,645.41

AMERCO	734	553.21	406,056.14
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	115.31	1,185,040.87
CSX CORP	179,261	32.63	5,849,286.43
DELTA AIR LINES INC	14,609	32.68	477,422.12
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	104.91	1,497,275.52
FEDEX CORP	20,314	218.16	4,431,702.24
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	3.05	253,183.55
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	182.59	1,287,624.68
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,697	52.99	725,804.03
LYFT INC-A	21,288	14.97	318,681.36
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	252.99	4,828,820.13
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	285.65	2,286,056.95
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	37.53	507,893.49
UBER TECHNOLOGIES INC	120,334	28.58	3,439,145.72
UNION PACIFIC CORP	51,838	231.27	11,988,574.26
UNITED PARCEL SERVICE B	59,627	198.93	11,861,599.11
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	41.05	294,533.75
APTIV PLC	22,415	94.55	2,119,338.25
BORGWARNER INC	19,781	37.97	751,084.57
FORD MOTOR COMPANY	321,972	15.41	4,961,588.52
GENERAL MOTORS CO	109,933	39.23	4,312,671.59
LEAR CORP	5,287	139.22	736,056.14
LUCID GROUP INC	31,234	16.24	507,240.16
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	32.11	429,085.93
TESLA INC	213,777	288.09	61,587,015.93
DR HORTON INC	27,764	72.81	2,021,496.84
GARMIN LTD	12,854	91.45	1,175,498.30
HASBRO INC	10,572	80.44	850,411.68
LENNAR CORP-CL A	20,844	80.33	1,674,398.52
LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	311.31	2,896,739.55
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	109.55	456,056.65
NEWELL BRANDS INC	31,461	19.56	615,377.16
NIKE B	103,874	108.28	11,247,476.72
NVR INC	247	4,224.99	1,043,572.53
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	10.61	230,618.96
PULTE GROUP INC	21,609	41.04	886,833.36
VF CORP	25,718	41.16	1,058,552.88
WHIRLPOOL CORP	5,220	159.33	831,702.60
AIRBNB INC-CLASS A	26,610	112.82	3,002,140.20
ARAMARK	20,955	35.42	742,226.10
BOOKING HOLDINGS INC	3,339	1,910.96	6,380,695.44
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	44.31	778,083.60

CARNIVAL CORPORATION	84,361	9.97	841,079.17
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,303	1,627.86	3,748,961.58
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	124.97	1,338,678.64
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	390.28	1,111,517.44
EXPEDIA GROUP INC	11,638	103.41	1,203,485.58
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	131.09	2,867,987.02
LAS VEGAS SANDS CORP	29,096	37.93	1,103,611.28
MARRIOTT INTL A	22,091	156.69	3,461,438.79
MCDONALD'S CORP	60,458	256.95	15,534,683.10
MGM RESORTS INTERNATIONAL	28,874	33.58	969,588.92
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,767	42.30	709,244.10
STARBUCKS CORP	93,796	84.06	7,884,491.76
VAIL RESORTS INC	3,014	229.00	690,206.00
WYNN RESORTS LTD	9,302	62.33	579,793.66
YUM BRANDS INC	22,637	112.16	2,538,965.92
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	78.63	4,846,989.09
ALPHABET INC-CL A	487,975	110.34	53,843,161.50
ALPHABET INC-CL C	460,933	111.30	51,301,842.90
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	9.17	351,119.30
CABLE ONE INC	445	1,192.46	530,644.70
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	9,809	425.77	4,176,377.93
COMCAST CORP-CL A	367,926	36.80	13,539,676.80
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	17.61	354,524.52
ELECTRONIC ARTS INC	23,158	132.17	3,060,792.86
FOX CORP - CLASS A	27,658	34.24	947,009.92
FOX CORP- CLASS B	10,345	31.72	328,143.40
IAC INC	6,721	64.90	436,192.90
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	28.54	965,622.36
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	104.83	1,181,224.44
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	68.48	1,053,153.92
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	42.18	572,973.12
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	42.36	270,426.24
LIVE NATION ENTERTAINMENT	12,343	91.80	1,133,087.40
MATCH GROUP INC	22,730	57.87	1,315,385.10
META PLATFORMS INC-CLASS A	187,450	161.78	30,325,661.00
NETFLIX INC	36,196	223.28	8,081,842.88
NEWS CORP-CLASS A	33,479	17.35	580,860.65
OMNICOM GROUP	16,538	68.45	1,132,026.10
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	24.90	1,209,791.40
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	23.08	1,056,302.36
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	39.56	1,110,014.04
ROKU INC	9,122	68.32	623,215.04

SEA LTD-ADR	28,338	63.82	1,808,531.16
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.17	373,087.56
SNAP INC - A	83,375	10.67	889,611.25
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	127.47	1,640,156.49
THE WALT DISNEY CO	148,022	114.07	16,884,869.54
TWITTER INC	63,066	40.46	2,551,650.36
WARNER BROS DISCOVERY INC	175,398	13.16	2,308,237.68
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	46.10	1,011,203.50
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	173.59	924,193.16
AMAZON.COM	742,757	130.75	97,115,477.75
AUTOZONE INC	1,639	2,163.02	3,545,189.78
BATH & BODY WORKS INC	19,806	36.83	729,454.98
BEST BUY COMPANY INC	18,175	74.15	1,347,676.25
BURLINGTON STORES INC	5,108	144.81	739,689.48
CARMAX INC	13,591	90.00	1,223,190.00
CARVANA CO	5,700	35.54	202,578.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	38.10	262,051.80
DOLLAR GENERAL CORP	18,686	236.32	4,415,875.52
DOLLAR TREE INC	17,931	138.70	2,487,029.70
DOORDASH INC - A	15,171	61.66	935,443.86
EBAY	46,820	44.53	2,084,894.60
ETSY INC	10,294	104.25	1,073,149.50
GENUINE PARTS CO	11,319	156.42	1,770,517.98
HOME DEPOT	84,800	298.10	25,278,880.00
LKQ CORP	22,779	53.99	1,229,838.21
LOWES COMPANIES	54,553	200.99	10,964,607.47
MERCADOLIBRE INC	3,725	877.80	3,269,805.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	698.79	3,778,357.53
POOL CORP	3,304	352.75	1,165,486.00
ROSS STORES INC	28,076	87.26	2,449,911.76
TARGET (DAYTON HUDSON)	39,126	160.62	6,284,418.12
TJX COMPANIES INC	97,454	62.89	6,128,882.06
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	191.06	1,704,637.32
ULTA BEAUTY INC	4,315	411.47	1,775,493.05
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	53.48	320,880.00
COSTCO WHOLESALE CORP	36,032	531.82	19,162,538.24
KROGER CO	56,126	48.38	2,715,375.88
SYSCO CORP	40,288	83.63	3,369,285.44
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	36.00	2,151,612.00
WALMART INC	124,048	131.60	16,324,716.80
ALTRIA GROUP INC	148,393	45.88	6,808,270.84
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,772	89.56	4,009,780.32

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	75.75	1,818,454.50
BUNGE LIMITED	11,604	102.32	1,187,321.28
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	50.69	804,399.61
COCA-COLA CO	334,608	63.11	21,117,110.88
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	49.37	760,078.75
CONAGRA BRANDS INC	40,304	34.91	1,407,012.64
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	251.90	3,259,586.00
GENERAL MILLS INC	49,534	76.32	3,780,434.88
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	228.67	2,748,384.73
HORMEL FOODS CORP	23,338	51.08	1,192,105.04
JM SMUCKER CO	9,145	141.59	1,294,840.55
KELLOGG CO	21,630	73.85	1,597,375.50
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	38.62	2,400,426.10
KRAFT HEINZ CO/THE	58,511	38.11	2,229,854.21
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	86.60	1,800,414.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	53.87	790,219.03
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	113,286	62.73	7,106,430.78
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	89.15	2,876,603.05
PEPSICO INC	112,413	175.04	19,676,771.52
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	126,117	96.55	12,176,596.35
TYSON FOODS INC	23,306	78.31	1,825,092.86
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	85.30	1,650,213.80
CLOROX COMPANY	9,570	144.73	1,385,066.10
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	79.21	5,052,647.48
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,016	261.88	4,979,910.08
KIMBERLY-CLARK CORP	26,841	129.52	3,476,446.32
PROCTER & GAMBLE CO	194,633	142.29	27,694,329.57
ABBOTT LABORATORIES	143,383	101.90	14,610,727.70
ABIOMED INC	3,781	258.12	975,951.72
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	252.45	1,500,310.35
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	146.19	1,885,266.24
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	57.17	2,287,543.21
BECTON DICKINSON & CO	23,274	253.73	5,905,312.02
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,818	40.52	4,733,465.36
CARDINAL HEALTH	21,902	67.60	1,480,575.20
CENTENE CORP	46,422	89.94	4,175,194.68
CIGNA CORP	26,188	284.87	7,460,175.56
CVS HEALTH CORP	106,862	100.06	10,692,611.72
DAVITA INC	4,627	88.65	410,183.55
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	33.61	597,384.14
DEXCOM INC	30,588	84.49	2,584,380.12
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49,627	91.24	4,527,967.48



ELEVANCE HEALTH INC	19,661	483.48	9,505,700.28
HCA HEALTHCARE INC	19,440	204.98	3,984,811.20
HENRY SCHEIN INC	11,747	73.39	862,112.33
HOLOGIC INC	19,018	67.71	1,287,708.78
HUMANA INC	10,365	486.71	5,044,749.15
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	349.90	2,362,174.90
INSULET CORP	5,311	267.17	1,418,939.87
INTUITIVE SURGICAL INC	29,197	211.09	6,163,194.73
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	229.16	1,740,470.20
MASIMO CORP	4,147	151.79	629,473.13
MCKESSON CORP	12,089	356.79	4,313,234.31
MEDTRONIC PLC	109,343	89.43	9,778,544.49
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	338.51	1,538,527.95
NOVOCURE LTD	7,933	82.77	656,614.41
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	127.10	1,271,635.50
RESMED INC	11,440	221.15	2,529,956.00
STERIS PLC	8,018	200.99	1,611,537.82
STRYKER CORP	27,055	207.00	5,600,385.00
TELADOC HEALTH INC	11,375	32.10	365,137.50
TELEFLEX INC	3,934	224.14	881,766.76
THE COOPER COS INC	4,134	296.57	1,226,020.38
UNITEDHEALTH GROUP INC	76,357	529.25	40,411,942.25
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	101.47	619,169.94
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	206.49	2,324,044.95
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,281	107.51	1,750,370.31
ABBVIE INC	143,718	136.35	19,595,949.30
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	129.87	3,088,957.95
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	210.94	2,034,094.42
AMGEN	45,347	240.65	10,912,755.55
AVANTOR INC	48,633	25.55	1,242,573.15
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	495.28	917,753.84
BIO-TECHNE CORP	3,245	338.74	1,099,211.30
BIOGEN INC	11,860	198.59	2,355,277.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	91.01	1,345,400.83
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	177,351	71.19	12,625,617.69
CATALENT INC	13,739	99.70	1,369,778.30
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	204.81	861,021.24
DANAHER CORP	55,252	280.33	15,488,793.16
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	15.38	554,618.18
EXACT SCIENCES CORP	14,756	36.91	544,643.96
GILEAD SCIENCES INC	99,836	62.37	6,226,771.32
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	61.00	1,093,486.00

ILLUMINA INC	12,506	205.37	2,568,357.22
INCYTE CORP	15,212	71.48	1,087,353.76
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	219.67	3,322,728.42
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	155.87	774,829.77
JOHNSON & JOHNSON	213,402	164.27	35,055,546.54
LILLY (ELI) & CO	65,773	315.56	20,755,327.88
MERCK & CO	205,447	89.26	18,338,199.22
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,251.91	2,263,453.28
MODERNA INC	27,309	136.70	3,733,140.30
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	104.87	888,668.38
PERKINELMER INC	10,545	137.57	1,450,675.65
PFIZER	456,781	46.82	21,386,486.42
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,497	596.18	5,065,741.46
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	43.05	1,124,810.40
SEAGEN INC	10,981	155.01	1,702,164.81
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.59	771,045.59
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,791	563.71	17,920,904.61
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,811	281.68	5,862,042.48
VIATRIS INC	90,748	9.88	896,590.24
WATERS CORP	4,749	300.81	1,428,546.69
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	303.77	1,751,841.59
ZOETIS INC	38,534	159.89	6,161,201.26
BANK OF AMERICA CORP	591,261	34.03	20,120,611.83
CITIGROUP	161,792	49.78	8,054,005.76
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	37.26	1,472,589.72
FIFTH THIRD BANCORP	52,803	34.95	1,845,464.85
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	813.77	773,081.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	155.64	2,145,808.68
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	13.64	1,556,487.68
JPMORGAN CHASE & CO	240,076	114.67	27,529,514.92
KEY CORP	71,472	18.43	1,317,228.96
M & T BANK CORP	14,037	184.02	2,583,088.74
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,513	162.19	5,597,663.47
REGIONS FINL CORP	79,314	21.97	1,742,528.58
SIGNATURE BANK	4,686	181.14	848,822.04
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	410.56	1,865,995.20
TRUIST FINANCIAL CORP	105,758	48.19	5,096,478.02
US BANCORP	112,247	46.49	5,218,363.03
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	48.04	685,674.92
WELLS FARGO & CO	310,526	43.97	13,653,828.22
ALLY FINANCIAL INC	27,761	34.39	954,700.79
AMERICAN EXPRESS	52,626	157.31	8,278,596.06

AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	274.84	2,391,657.68
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	56.37	1,795,609.98
BANK NEW YORK CO	61,254	42.00	2,572,668.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,127	289.96	30,482,624.92
BLACKROCK INC	12,394	676.44	8,383,797.36
BLACKSTONE INC	57,841	98.55	5,700,230.55
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,256	109.82	3,652,173.92
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	33.09	518,487.21
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	120.35	1,068,106.25
CME GROUP INC	29,373	196.35	5,767,388.55
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	66.74	639,102.24
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	102.70	2,403,488.10
EQUITABLE HOLDINGS INC	34,355	30.38	1,043,704.90
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	445.12	1,401,237.76
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	26.49	690,594.30
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	46.34	200,003.44
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,736	336.40	9,330,390.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	103.59	4,630,783.77
INVESCO LTD	26,420	17.26	456,009.20
KKR & CO INC	44,282	51.63	2,286,279.66
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	226.16	1,444,257.76
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	244.95	785,554.65
MOODY'S CORP	13,365	292.91	3,914,742.15
MORGAN STANLEY	108,856	86.81	9,449,789.36
MSCI INC	6,518	456.42	2,974,945.56
NASDAQ INC	9,657	182.07	1,758,249.99
NORTHERN TRUST CORP	15,902	95.40	1,517,050.80
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	119.68	2,143,109.76
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	106.78	1,653,595.08
S&P GLOBAL INC	28,938	364.06	10,535,168.28
SCHWAB (CHARLES) CORP	118,155	71.89	8,494,162.95
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	54.53	520,761.50
STATE STREET CORP	30,359	69.13	2,098,717.67
SYNCHRONY FINANCIAL	41,566	33.65	1,398,695.90
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	70.49	638,709.89
UPSTART HOLDINGS INC	3,148	25.21	79,361.08
AFLAC	50,591	60.87	3,079,474.17
ALLEGHANY CORP	1,080	841.21	908,506.80
ALLSTATE CORP	22,174	125.05	2,772,858.70
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	131.71	832,275.49
AMERICAN INT'L GROUP	65,898	53.00	3,492,594.00
AON PLC	17,038	285.87	4,870,653.06

ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	46.50	1,382,259.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	187.70	3,070,584.30
ASSURANT INC	4,726	161.55	763,485.30
BROWN & BROWN INC	19,873	65.09	1,293,533.57
CHUBB LTD	34,810	193.51	6,736,083.10
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	100.83	1,289,716.53
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	217.70	471,538.20
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	272.92	897,360.96
FNF GROUP	20,461	40.27	823,964.47
GLOBE LIFE INC	8,106	98.76	800,548.56
HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	66.20	1,835,130.20
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	47.57	641,433.88
LOEWS CORP	16,741	56.80	950,888.80
MARKEL CORP	1,156	1,219.68	1,409,950.08
MARSH & MCLENNAN COS	41,045	165.96	6,811,828.20
METLIFE INC	57,127	65.68	3,752,101.36
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	76.61	1,587,282.59
PROGRESSIVE CORP	48,534	125.16	6,074,515.44
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,511	98.52	2,907,423.72
TRAVELERS COS INC/THE	19,772	166.84	3,298,760.48
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,385	207.81	1,950,296.85
WR BERKLEY CORP	17,572	66.54	1,169,240.88
CBRE GROUP INC-A	27,714	80.43	2,229,037.02
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.89	482,643.00
WEYERHAEUSER CO	58,295	35.38	2,062,477.10
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	34.06	457,323.62
ACCENTURE PLC-CL A	51,384	298.13	15,319,111.92
ADOBE INC	38,347	381.02	14,610,973.94
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	24.57	314,889.12
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	92.04	1,258,462.92
ANSYS INC	6,794	254.31	1,727,782.14
APPLOVIN CORP-CLASS A	10,000	25.75	257,500.00
AUTODESK INC	17,467	207.77	3,629,118.59
AUTOMATIC DATA PROCESS	34,246	250.48	8,577,938.08
AVALARA INC	6,847	91.82	628,691.54
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	37.29	521,910.84
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	167.66	1,247,893.38
BLACK KNIGHT INC	11,543	67.23	776,035.89
BLOCK INC	41,288	68.87	2,843,504.56
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	173.99	1,695,010.58
CADENCE DESIGN SYSTEMS	22,740	177.83	4,043,854.20
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	61.21	652,988.28

CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	121.68	988,528.32
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	102.45	1,069,987.80
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	64.39	1,306,022.37
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	43,220	64.70	2,796,334.00
COUPA SOFTWARE INC	6,059	58.65	355,360.35
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,760	194.56	3,066,265.60
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	148.25	459,575.00
DATADOG INC - CLASS A	18,646	106.73	1,990,087.58
DOCUSIGN INC	14,969	58.02	868,501.38
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	22.05	508,649.40
DYNATRACE INC	14,790	38.16	564,386.40
EPAM SYSTEMS INC	4,403	422.57	1,860,575.71
FAIR ISAAC CORP	2,125	476.85	1,013,306.25
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	49,912	93.09	4,646,308.08
FISERV INC	49,921	103.83	5,183,297.43
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	221.38	1,328,722.76
FORTINET INC	56,318	49.57	2,791,683.26
GARTNER INC	6,340	294.95	1,869,983.00
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	125.13	2,823,808.71
GODADDY INC - CLASS A	13,798	77.73	1,072,518.54
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	72.25	456,475.50
HUBSPOT INC	3,646	335.33	1,222,613.18
INTL BUSINESS MACHINES CORP	73,262	130.38	9,551,899.56
INTUIT INC	21,909	448.46	9,825,310.14
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	197.47	1,242,283.77
MASTERCARD INC-CLASS A	70,879	331.96	23,528,992.84
MICROSOFT CORP	577,361	268.09	154,784,710.49
MONGODB INC	5,325	353.57	1,882,760.25
NORTONLIFELOCK INC	43,549	22.70	988,562.30
OKTA INC	11,505	93.48	1,075,487.40
ORACLE CORP	130,499	74.65	9,741,750.35
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	7.94	994,437.36
PALO ALTO NETWORKS INC	8,079	560.69	4,529,814.51
PAYCHEX INC	26,693	128.80	3,438,058.40
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	360.60	1,527,141.00
PAYPAL HOLDINGS INC	90,208	92.70	8,362,281.60
PTC INC	8,304	114.59	951,555.36
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	42.42	271,191.06
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,672	409.83	3,554,045.76
SALESFORCE INC	80,094	165.23	13,233,931.62
SERVICENOW INC	16,309	444.69	7,252,449.21
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,680	197.71	3,495,512.80

SPLUNK INC	13,355	94.42	1,260,979.10
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	57.16	1,105,188.60
SYNOPSYS INC	12,539	355.00	4,451,345.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	63.41	2,325,308.11
TWILIO INC - A	12,842	72.34	928,990.28
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	378.26	1,263,010.14
UNITY SOFTWARE INC	16,329	44.58	727,946.82
VERISIGN INC	7,790	187.51	1,460,702.90
VISA INC-CLASS A SHARES	134,653	202.89	27,319,747.17
VMWARE INC-CLASS A	16,717	118.71	1,984,475.07
WESTERN UNION CO	29,297	15.23	446,193.31
WIX.COM LTD	5,010	64.09	321,090.90
WORKDAY INC-CLASS A	15,615	166.46	2,599,272.90
ZENDESK INC	8,890	76.53	680,351.70
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	81.41	1,386,249.48
ZSCALER INC	6,234	161.19	1,004,858.46
AMPHENOL CORPORATION	47,707	75.47	3,600,447.29
APPLE INC	1,323,029	163.62	216,474,004.98
ARISTA NETWORKS INC	20,350	123.03	2,503,660.50
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	107.19	653,859.00
CDW CORP/DE	10,882	179.69	1,955,386.58
CISCO SYSTEMS	337,789	45.89	15,501,137.21
COGNEX CORP	14,352	44.85	643,687.20
CORNING	64,989	34.64	2,251,218.96
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	41.43	931,387.83
F5 INC	4,851	160.17	776,984.67
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	98,742	13.76	1,358,689.92
HP INC	83,910	31.39	2,633,934.90
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	29.39	744,184.19
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	167.08	2,504,362.12
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,836	248.32	3,435,755.52
NETAPP INC	18,303	74.96	1,371,992.88
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	74.62	1,237,423.46
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	126.77	3,304,640.36
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	383.70	1,496,046.30
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	66.00	1,397,616.00
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	45.49	1,173,187.10
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	308.16	1,282,561.92
AT&T INC	581,626	17.89	10,405,289.14
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	20.13	312,337.08
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	21.40	588,221.80
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	10.76	793,754.44

T-MOBILE US INC	50,968	143.02	7,289,443.36
VERIZON COMMUNICATIONS	341,350	43.25	14,763,387.50
AES CORP	54,375	25.63	1,393,631.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	62.27	1,293,846.06
AMEREN CORPORATION	20,898	94.79	1,980,921.42
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,156	101.82	4,088,683.92
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	151.09	2,141,549.66
ATMOS ENERGY CORP	10,802	115.99	1,252,923.98
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	31.75	1,529,143.50
CMS ENERGY CORP	23,697	68.76	1,629,405.72
CONSOLIDATED EDISON INC	29,197	98.53	2,876,780.41
CONSTELLATION ENERGY	25,732	80.83	2,079,917.56
DOMINION ENERGY INC	64,535	83.08	5,361,567.80
DTE ENERGY COMPANY	15,851	133.22	2,111,670.22
DUKE ENERGY CORP	62,802	108.73	6,828,461.46
EDISON INTL	30,339	69.27	2,101,582.53
ENERGY CORP	16,181	118.97	1,925,053.57
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	50.28	1,025,661.72
EVERGY INC	18,475	69.48	1,283,643.00
EVERSOURCE ENERGY	28,450	91.60	2,606,020.00
EXELON CORP	77,196	44.71	3,451,433.16
FIRSTENERGY CORP	45,165	40.19	1,815,181.35
NEXTERA ENERGY INC	159,643	88.06	14,058,162.58
NISOURCE INC	32,351	30.18	976,353.18
NRG ENERGY INC	19,068	41.72	795,516.96
PG&E CORP	118,132	12.48	1,474,287.36
PPL CORPORATION	58,459	29.79	1,741,493.61
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	66.69	2,632,120.92
SEMPRA ENERGY	25,885	166.54	4,310,887.90
SOUTHERN CO	86,558	78.20	6,768,835.60
UGI CORP	18,019	40.19	724,183.61
VISTRA CORP	37,797	24.93	942,279.21
WEC ENERGY GROUP INC	26,033	104.79	2,727,998.07
XCEL ENERGY INC	43,741	74.93	3,277,513.13
ADVANCED MICRO DEVICES	132,978	91.18	12,124,934.04
ANALOG DEVICES	42,691	158.67	6,773,780.97
APPLIED MATERIALS	72,040	98.80	7,117,552.00
BROADCOM INC	33,289	520.86	17,338,908.54
ENPHASE ENERGY INC	11,020	288.59	3,180,261.80
ENTEGRIS INC	12,483	100.11	1,249,673.13
INTEL CORP	331,419	33.36	11,056,137.84
KLA CORP	12,119	359.18	4,352,902.42

	LAM RESEARCH CORP	11,398	453.31	5,166,827.38
	MARVELL TECHNOLOGY INC	67,204	50.17	3,371,624.68
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	65.96	2,921,302.44
	MICRON TECHNOLOGY	91,511	57.63	5,273,778.93
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	476.62	1,682,945.22
	NVIDIA CORP	202,894	162.60	32,990,564.40
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	168.12	3,504,965.76
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	71.58	2,467,219.44
	QORVO INC	8,556	95.70	818,809.20
	QUALCOMM	91,671	138.38	12,685,432.98
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	102.40	1,369,292.80
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,214	287.93	1,213,337.02
	TERADYNE INC	12,318	90.16	1,110,590.88
	TEXAS INSTRUMENTS	75,121	169.49	12,732,258.29
	アメリカドル 小計	27,731,211		2,863,475,167.44 (396,133,154,663)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	18.58	1,019,298.80
	CAMECO CORP	31,793	34.74	1,104,488.82
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,374	74.16	7,147,095.84
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	25.15	2,799,018.95
	ENBRIDGE	165,402	56.80	9,394,833.60
	IMPERIAL OIL	16,573	65.66	1,088,183.18
	KEYERA CORP	18,607	32.15	598,215.05
	PARKLAND CORP	14,075	32.82	461,941.50
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	48.28	2,204,754.48
	SUNCOR ENERGY	116,208	44.73	5,197,983.84
	TC ENERGY CORP	77,328	65.74	5,083,542.72
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	79.49	1,987,965.41
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	56.82	2,065,634.28
	BARRICK GOLD CORP	139,009	20.17	2,803,811.53
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	64.27	844,443.53
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	25.83	1,110,690.00
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	165.52	2,542,883.76
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	9.02	467,659.94
	KINROSS GOLD CORP	108,451	4.45	482,606.95
	LUNDIN MINING CORP	62,243	7.24	450,639.32
	NUTRIEN LTD	44,786	130.88	5,861,591.68
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	20.69	380,923.59
	TECK RESOURCES LTD-CL B	40,179	47.44	1,906,091.76
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	122.78	748,958.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	41.26	1,412,659.88
	CAE INC	25,999	25.04	651,014.96



TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	105.49	800,141.65
WSP GLOBAL INC	9,951	155.92	1,551,559.92
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	36.88	498,064.40
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	90.64	928,606.80
THOMSON REUTERS CORP	13,293	144.27	1,917,781.11
AIR CANADA	13,805	18.21	251,389.05
CANADIAN NATL RAILWAY CO	48,612	160.99	7,826,045.88
CP RAILWAY LIMITED	75,991	103.57	7,870,387.87
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	139.95	816,888.15
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	76.89	1,790,152.98
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	94.94	291,465.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	39.46	673,937.34
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	77.10	1,778,928.30
QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.91	439,432.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	34.94	1,237,644.68
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	161.24	727,676.12
DOLLARAMA INC	22,000	80.48	1,770,560.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	56.97	3,843,594.99
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	38.41	585,867.73
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	117.31	1,514,824.03
METRO INC	18,840	70.06	1,319,930.40
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	154.88	809,402.88
SAPUTO INC	20,898	33.24	694,649.52
BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	6.74	140,192.00
BANK MONTREAL	53,040	128.53	6,817,231.20
BANK NOVA SCOTIA	99,336	74.80	7,430,332.80
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,829	64.94	4,664,575.26
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	89.76	2,449,460.64
ROYAL BANK OF CANADA	115,288	124.97	14,407,541.36
TORONTO-DOMINION BANK	148,462	86.87	12,896,893.94
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	116,005	64.11	7,437,080.55
IGM FINANCIAL INC	7,685	36.32	279,119.20
ONEX CORP	6,603	65.75	434,147.25
TMX GROUP LTD	4,685	131.67	616,873.95
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	654.41	1,395,856.53
GREAT-WEST LIFE CO INC	23,788	32.80	780,246.40
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	70.79	714,908.21
INTACT FINANCIAL CORP	15,012	192.44	2,888,909.28
MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	23.26	3,600,136.28
POWER CORP OF CANADA	43,577	34.55	1,505,585.35
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	59.19	2,705,101.38
FIRSTSERVICE CORP	2,690	167.02	449,283.80

	BLACKBERRY LIMITED	39,400	7.94	312,836.00
	CGI INC - CL A	18,300	104.65	1,915,095.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	2,025.00	3,248,100.00
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	25.35	210,303.60
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	39.93	171,738.93
	OPEN TEXT CORP	20,463	41.54	850,033.02
	SHOPIFY INC - CLASS A	92,560	42.23	3,908,808.80
	BCE INC	6,203	64.65	401,023.95
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	26,167	57.40	1,501,985.80
	TELUS CORP	32,908	30.10	990,530.80
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.47	957,078.46
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	29.73	725,263.35
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	51.21	578,416.95
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	41.23	425,658.52
	EMERA INC	23,223	61.35	1,424,731.05
	FORTIS INC	36,823	58.83	2,166,297.09
	HYDRO ONE LTD	23,269	35.36	822,791.84
	NORTHLAND POWER INC	17,854	45.68	815,570.72
	カナダドル 小計	3,313,371		192,795,602.23 (20,415,126,320)
ユーロ	ENI	197,669	12.31	2,434,491.40
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	11.14	442,032.99
	NESTE OIL OYJ	36,735	51.18	1,880,097.30
	OMV AG	12,549	41.53	521,159.97
	REPSOL SA	111,112	13.43	1,492,234.16
	TENARIS SA	40,648	13.90	565,210.44
	TOTALENERGIES SE	203,322	53.96	10,971,255.12
	AIR LIQUIDE	43,239	129.64	5,605,503.96
	AKZO NOBEL	15,301	63.78	975,897.78
	ARCELORMITTAL	48,641	23.53	1,144,765.93
	ARKEMA	4,369	83.56	365,073.64
	BASF SE	73,837	40.94	3,022,886.78
	COVESTRO AG	14,454	29.38	424,658.52
	CRH PLC	59,653	37.88	2,259,655.64
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	18.62	298,689.12
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	44.20	576,412.20
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	134.00	1,836,738.00
	OCI NV	12,000	41.32	495,840.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	33.06	644,802.24
	SOLVAY SA	5,356	80.38	430,515.28
	STORA ENSO OYJ R	42,169	14.89	627,896.41
	SYMRISE AG	11,830	107.45	1,271,133.50

UMICORE	17,605	32.62	574,275.10
UPM KYMMENE OYJ	42,324	34.25	1,449,597.00
VOESTALPINE AG	7,152	19.95	142,682.40
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	22,552	22.42	505,615.84
AIRBUS SE	46,955	101.92	4,785,653.60
ALSTOM	24,388	20.61	502,636.68
BOUYGUES ORD	16,606	29.22	485,227.32
BRENTAG SE	12,514	66.70	834,683.80
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.53	1,015,255.78
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	25.34	846,218.86
DASSAULT AVIATION SA	2,130	140.60	299,478.00
EIFFAGE	5,924	87.70	519,534.80
FERROVIAL SA	43,631	25.87	1,128,733.97
GEA GROUP AG	13,382	35.36	473,187.52
IMCD NV	4,641	146.80	681,298.80
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	57.52	713,132.96
KION GROUP AG	5,887	39.58	233,007.46
KNORR-BREMSE AG	5,022	48.37	242,914.14
KONE OYJ-B	26,311	39.92	1,050,335.12
LEGRAND SA	21,768	73.96	1,609,961.28
MTU AERO ENGINES AG	3,962	182.50	723,065.00
PRYSMIAN SPA	21,155	31.69	670,401.95
RATIONAL AG	483	559.50	270,238.50
RHEINMETALL AG	3,660	166.85	610,671.00
SAFRAN SA	28,774	104.80	3,015,515.20
SAINT-GOBAIN	40,093	40.79	1,635,593.93
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,670	124.70	5,570,349.00
SIEMENS	61,200	102.90	6,297,480.00
SIEMENS ENERGY AG	36,841	15.35	565,509.35
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	17.93	402,259.55
THALES SA	8,524	123.90	1,056,123.60
VINCI S.A.	42,507	91.95	3,908,518.65
WARTSILA OYJ	41,917	8.34	349,755.44
BUREAU VERITAS SA	25,073	25.53	640,113.69
RANDSTAD NV	10,558	46.42	490,102.36
TELEPERFORMANCE	4,734	289.00	1,368,126.00
WOLTERS KLUWER	20,839	103.85	2,164,130.15
ADP	2,382	138.30	329,430.60
AENA SME SA	5,508	124.40	685,195.20
ATLANTIA SPA	35,937	22.83	820,441.71
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	5.84	265,029.83
DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	36.87	2,902,185.18

GETLINK	35,220	19.34	681,330.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	73.12	1,908,943.84
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	69.15	345,127.65
CONTINENTAL AG	8,168	56.38	460,511.84
FERRARI NV	10,170	199.85	2,032,474.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	64,434	55.00	3,543,870.00
MICHELIN	55,356	24.26	1,343,213.34
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	67.18	789,029.10
RENAULT SA	17,362	27.40	475,805.61
STELLANTIS NV	175,794	13.74	2,415,409.56
VALEO SA	16,596	18.59	308,602.62
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,874	140.94	2,237,281.56
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	184.80	459,412.80
ADIDAS AG	13,972	151.54	2,117,316.88
ESSILORLUXOTTICA	22,910	151.90	3,480,029.00
HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,336.50	3,393,373.50
KERING	6,271	528.90	3,316,731.90
LVMH	22,668	669.00	15,164,892.00
MONCLER SPA	19,057	45.62	869,380.34
PUMA SE	9,220	62.10	572,562.00
SEB SA	2,282	75.65	172,633.30
ACCOR	14,436	24.07	347,474.52
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	125.75	1,640,786.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	32.68	264,969.44
SODEXO	6,027	77.96	469,864.92
BOLLORE SE	83,646	4.70	393,470.78
PUBLICIS GROUPE	17,077	49.37	843,091.49
SCOUT24 SE	7,492	56.02	419,701.84
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	44.50	314,659.50
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	20.39	1,248,744.77
VIVENDI SE	61,243	9.03	553,514.23
D' IETEREN GROUP	2,217	154.90	343,413.30
DELIVERY HERO SE	13,414	42.41	568,887.74
INDITEX	87,326	22.27	1,944,750.02
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	17.47	272,042.84
PROSUS	66,706	64.93	4,331,220.58
ZALANDO SE	17,664	23.27	411,041.28
CARREFOUR	52,544	16.90	887,993.60
HELLOFRESH SE	13,805	24.58	339,326.90
JERONIMO MARTINS	24,901	22.78	567,244.78
KESKO OYJ-B SHS	20,083	21.35	428,772.05
KONINKLIJKE AHOLD NV	86,170	27.52	2,371,398.40

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,711	50.28	3,454,789.08
DANONE (GROUPE)	51,543	52.42	2,701,884.06
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	10.22	501,566.94
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	72.50	670,697.50
HEINEKEN NV	20,157	91.56	1,845,574.92
JDE PEET'S BV	7,000	31.04	217,280.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	104.35	1,361,767.50
PERNOD-RICARD	16,694	187.85	3,135,967.90
REMY COINTREAU	1,382	194.70	269,075.40
BEIERSDORF AG	7,430	103.55	769,376.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	63.55	557,969.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	65.18	941,134.02
LOREAL	19,843	352.75	6,999,618.25
AMPLIFON SPA	11,650	26.06	303,599.00
BIOMERIEUX	3,044	104.85	319,163.40
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	127.55	437,496.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	132.50	274,275.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	34.35	583,434.75
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	24.80	835,487.20
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	16.97	1,218,256.39
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	434.40	792,345.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	48.45	1,044,921.15
ARGENX SE	3,976	391.10	1,555,013.60
BAYER	78,757	53.70	4,229,250.90
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	71.04	726,028.80
GRIFOLS SA	27,685	12.42	343,847.70
IPSEN	3,532	96.75	341,721.00
MERCK KGAA	10,555	173.70	1,833,403.50
ORION OYJ-CLASS B	9,854	47.03	463,433.62
QIAGEN N.V.	17,038	47.16	803,512.08
RECORDATI SPA	9,859	42.12	415,261.08
SANOFI	93,369	81.89	7,645,987.41
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,539	378.40	960,757.60
UCB (GROUPE)	9,389	71.70	673,191.30
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	9.51	379,728.55
BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	4.45	2,381,758.29
BANCO SANTANDER SA	1,393,640	2.40	3,355,188.30
BNP PARIBAS	92,730	45.85	4,251,670.50
CAIXABANK	330,447	2.88	951,687.36
COMMERZBANK AG	81,889	6.22	509,349.58
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	9.11	906,514.09
ERSTE GROUP BANK AG	31,905	21.66	691,062.30

FINECOBANK SPA	53,120	10.70	568,384.00
ING GROEP NV-CVA	324,888	8.72	2,834,972.68
INTESA SANPAOLO	1,322,943	1.68	2,229,158.95
KBC GROEP NV	18,608	46.32	861,922.56
MEDIOBANCA	53,990	7.93	428,248.68
SOCIETE GENERALE	63,329	21.59	1,367,589.75
UNICREDIT SPA	168,352	9.10	1,532,003.20
AMUNDI SA	4,626	50.90	235,463.40
DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	8.17	1,312,368.82
DEUTSCHE BOERSE	14,999	169.55	2,543,080.45
EURAZEO SA	3,357	61.25	205,616.25
EURONEXT NV	6,480	75.72	490,665.60
EXOR NV	7,825	62.70	490,627.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	76.14	648,332.10
SOFINA	1,238	200.20	247,847.60
WENDEL	2,023	80.40	162,649.20
AEGON	148,741	4.49	668,739.53
AGEAS	11,086	40.40	447,874.40
ALLIANZ SE-REG	32,696	170.58	5,577,283.68
ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	14.72	1,261,004.82
AXA SA	154,335	23.43	3,616,069.05
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	146.10	633,051.30
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,889	235.30	2,797,481.70
NN GROUP NV	22,611	40.06	905,796.66
POSTE ITALIANE SPA	46,035	7.86	362,111.31
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	44.99	1,739,088.45
AROUNDTOWN SA	64,068	2.91	186,950.42
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	75.94	400,583.50
VONOVIA SE	59,080	26.56	1,569,164.80
ADYEN NV	1,746	1,602.00	2,797,092.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	54.80	1,950,003.20
BECHTLE AG	7,659	39.82	304,981.38
CAPGEMINI SA	13,877	178.40	2,475,656.80
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	39.55	2,087,198.68
EDENRED	18,664	50.56	943,651.84
NEMETSCHKE SE	5,455	61.52	335,591.60
NEXI SPA	48,458	8.06	390,765.31
SAP SE	85,927	85.29	7,328,713.83
WORLDLINE SA	20,332	40.82	829,952.24
NOKIA OYJ	427,600	4.94	2,114,695.80
CELLNEX TELECOM SA	46,824	39.92	1,869,214.08
DEUTSCHE TELEKOM	258,113	18.67	4,820,518.38

ELISA A	10,227	53.68	548,985.36
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.49	288,501.75
KPN (KON.)	282,927	3.18	899,707.86
ORANGE	153,815	10.02	1,542,149.19
PROXIMUS	13,141	12.79	168,073.39
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.20	176,904.54
TELEFONICA	431,420	4.14	1,787,804.48
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.55	252,118.11
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	22.67	215,659.71
ACCIONA SA	2,181	206.00	449,286.00
E.ON SE	195,549	8.51	1,664,513.08
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	25.86	555,110.76
ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.94	471,880.74
ELIA GROUP SA/NV	3,125	155.20	485,000.00
ENAGAS	21,663	19.30	418,204.21
ENDESA	25,972	17.86	463,989.78
ENEL	650,125	4.83	3,141,729.06
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	5.13	1,158,564.39
ENGIE	141,564	12.75	1,805,224.12
FORTUM OYJ	32,550	10.03	326,639.25
IBERDROLA SA	477,647	10.92	5,218,293.47
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	29.58	296,095.80
RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	19.42	595,766.76
RWE STAMM	49,680	40.99	2,036,383.20
SNAM SPA	147,559	5.00	738,975.47
TERNA SPA	102,810	7.62	783,412.20
UNIPER SE	7,335	5.42	39,792.37
VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	22.61	1,153,720.47
VERBUND AG	6,430	109.60	704,728.00
ASM INTERNATIONAL NV	3,483	289.15	1,007,109.45
ASML HOLDING NV	33,005	521.40	17,208,807.00
INFINEON TECHNOLOGIES	110,035	24.96	2,747,023.77
STMICROELECTRONICS	55,076	35.56	1,958,777.94
ユーロ 小計	14,873,040		334,706,062.72 (45,975,224,775)
イギリスポンド			
BP PLC	1,596,790	4.57	7,310,104.62
SHELL PLC-NEW	620,239	23.34	14,476,378.26
ANGLO AMERICAN PLC	102,156	29.22	2,985,509.10
ANTOFAGASTA PLC	35,856	11.74	420,949.44
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	68.42	747,420.08
GLENCORE PLC	817,868	4.98	4,080,343.45
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	20.51	345,552.48

MONDI PLC	36,710	14.60	535,966.00
RIO TINTO PLC REG	89,551	49.80	4,459,639.80
ASHTED GROUP PLC	37,687	42.98	1,619,787.26
BAE SYSTEMS PLC	260,104	8.13	2,114,645.52
BUNZL PLC	24,880	31.15	775,012.00
DCC PLC	6,622	50.66	335,470.52
FERGUSON PLC	17,761	100.85	1,791,196.85
MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.39	445,609.24
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	0.78	499,061.38
SMITHS GROUP PLC	26,476	15.15	401,111.40
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	106.20	585,586.80
EXPERIAN PLC	74,115	26.83	1,988,505.45
INTERTEK GROUP PLC	13,890	40.21	558,516.90
RELX PLC	154,242	23.03	3,552,193.26
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.33	748,758.40
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.29	314,695.39
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	37.10	285,224.80
BURBERRY GROUP PLC	29,776	17.35	516,613.60
PERSIMMON PLC	25,686	14.97	384,647.85
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.09	289,193.88
COMPASS GROUP PLC	142,427	18.76	2,671,930.52
ENTAIN PLC	49,630	12.46	618,637.95
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	47.50	703,522.50
WHITBREAD PLC	17,434	25.07	437,070.38
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.50	471,437.77
INFORMA PLC	110,598	5.48	606,961.82
PEARSON	55,305	8.68	480,158.01
WPP PLC	95,821	7.43	712,524.95
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.09	226,783.61
KINGFISHER PLC	153,717	2.30	353,856.53
NEXT PLC	11,468	57.32	657,345.76
OCADO GROUP PLC	54,753	7.31	400,353.93
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.02	300,675.04
TESCO PLC	601,050	2.52	1,518,853.35
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	15.15	390,089.70
BRITISH AMERICAN TOBACCO	178,799	34.62	6,190,915.37
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	19.80	355,608.00
DIAGEO	189,615	38.25	7,253,721.82
IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	18.77	1,428,021.60
HALEON PLC	405,046	2.66	1,078,637.49
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,022	65.80	3,752,047.60
UNILEVER PLC	209,465	39.35	8,242,447.75



	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.08	691,437.60
	ASTRAZENECA	126,291	113.64	14,351,709.24
	GSK PLC	334,172	13.94	4,661,031.05
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	13.36	219,825.44
	BARCLAYS	1,339,545	1.62	2,171,402.44
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,655,458	5.23	8,658,045.34
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,667,831	0.43	2,475,141.79
	NATWEST GROUP PLC	443,701	2.50	1,113,245.80
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.89	1,252,581.61
	3I GROUP PLC	74,757	11.93	891,851.01
	ABRDN PLC	153,430	1.47	225,618.81
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.48	280,642.23
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	82.68	2,174,235.96
	M&G PLC	229,107	1.96	449,164.27
	SCHRODERS PLC	11,794	27.22	321,032.68
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	11.25	460,712.17
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	21.92	356,309.60
	AVIVA PLC	225,378	4.20	947,714.49
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.55	1,177,239.24
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.00	306,108.00
	PRUDENTIAL	230,270	9.15	2,106,970.50
	AVEVA GROUP PLC	10,917	27.90	304,584.30
	SAGE GROUP PLC	76,660	7.25	556,244.96
	HALMA PLC	31,069	21.21	658,973.49
	BT GROUP PLC	557,358	1.51	844,118.69
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.15	2,537,221.69
	NATIONAL GRID PLC	302,035	11.37	3,435,648.12
	SEVERN TRENT PLC	22,468	28.50	640,338.00
	SSE PLC	90,604	18.02	1,633,137.10
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.86	636,178.80
	イギリスポンド 小計	23,111,209		147,957,759.60 (23,907,014,796)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	17.69	307,770.62
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	694.50	398,643.00
	GIVAUDAN-REG	748	3,161.00	2,364,428.00
	HOLCIM LTD	44,847	43.67	1,958,468.49
	SIKA AG-BR	11,714	222.70	2,608,707.80
	ABB LTD	137,175	27.53	3,776,427.75
	GEBERIT AG-REG	2,964	456.10	1,351,880.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	166.00	339,968.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	170.25	526,413.00
	VAT GROUP AG	1,956	242.40	474,134.40

	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	30.43	317,993.50	
	SGS SA	506	2,197.00	1,111,682.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	234.10	1,071,475.70	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,318	111.40	4,825,625.20	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	237.00	588,471.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	44.10	173,665.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,026.00	567,280.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	107,500.00	860,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,480.00	859,360.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	229,173	115.50	26,469,481.50	
	ALCON INC	39,333	65.40	2,572,378.20	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,686	265.70	1,245,070.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	109.65	936,411.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	66.70	123,395.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	537.40	3,167,973.00	
	NOVARTIS	179,027	80.37	14,388,399.99	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	378.20	837,713.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	57,316	316.75	18,154,843.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	5.12	1,092,316.16	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	47.53	898,174.41	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	967.80	1,773,977.40	
	UBS GROUP AG	281,888	15.26	4,303,020.32	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,174	143.80	456,421.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	506.80	1,225,949.20	
	SWISS RE LTD	24,445	73.98	1,808,441.10	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,053	434.10	5,232,207.30	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	85.20	483,850.80	
	TEMENOS AG - REG	5,150	77.00	396,550.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	49.72	730,187.92	
	SWISSCOM	2,187	505.00	1,104,435.00	
	スイスフラン 小計	1,401,947		111,883,590.36 (15,976,976,703)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	365.95	8,143,119.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	10,000	449.20	4,492,000.00	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	158.00	6,934,146.00	
	ALFA LAVAL AB	27,268	291.00	7,934,988.00	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	220.90	17,265,102.20	
	ATLAS COPCO A	227,097	111.50	25,321,315.50	
	ATLAS COPCO B	127,608	99.17	12,654,885.36	
	EPIROC AB-A	53,479	167.80	8,973,776.20	
	EPIROC AB-B	28,804	150.90	4,346,523.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	72.00	2,787,264.00	

	INDUTRADE AB	22,644	207.60	4,700,894.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	213.50	2,989,427.00	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	169.65	3,048,610.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	99.86	12,267,601.28	
	SANDVIK AB	87,644	170.40	14,934,537.60	
	SKANSKA B	25,507	157.00	4,004,599.00	
	SKF AB-B	37,718	165.00	6,223,470.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	177.70	2,401,437.80	
	VOLVO B	121,238	171.30	20,768,069.40	
	SECURITAS B	29,533	94.00	2,776,102.00	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	66.83	3,330,740.37	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	136.54	2,904,069.26	
	EVOLUTION AB	14,096	871.10	12,279,025.60	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	65.98	3,506,639.06	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	111.18	6,140,360.22	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	106.65	13,573,345.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	246.90	12,215,130.60	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	205.50	3,657,078.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	234.80	3,365,858.00	
	NORDEA BANK ABP	279,221	100.78	28,139,892.38	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	107.10	14,056,339.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	88.44	9,793,491.84	
	SWEDBANK AB-A	72,526	135.75	9,845,404.50	
	EQT AB	23,207	236.90	5,497,738.30	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	240.50	2,842,229.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	237.90	2,656,867.20	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	186.35	7,253,673.75	
	INVESTOR AB-B SHS	142,777	174.22	24,874,608.94	
	KINNEVIK AB - B	18,792	154.55	2,904,303.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	416.00	3,028,480.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	59.66	3,382,722.00	
	SAGAX AB-B	12,402	229.80	2,849,979.60	
	SINCH AB	44,150	18.79	829,843.40	
	ERICSSON (LM) B	225,508	77.63	17,506,186.04	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	114.85	17,668,294.30	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	113.75	5,319,177.50	
	TELIA CO AB	230,643	37.99	8,762,127.57	
	スウェーデンクローナ 小計	3,170,036		401,151,475.27 (5,178,865,545)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	27,755	367.00	10,186,085.00	
	EQUINOR ASA	81,436	406.15	33,075,231.40	
	NORSK HYDRO	96,800	71.10	6,882,480.00	

	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	416.00	5,199,168.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	348.40	3,011,918.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	70.75	1,352,527.75	
	MOWI ASA	31,968	206.60	6,604,588.80	
	ORKLA	69,804	83.06	5,797,920.24	
	SALMAR ASA	5,423	653.50	3,543,930.50	
	DNB BANK ASA	71,795	189.85	13,630,280.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	205.60	3,818,814.40	
	TELENOR ASA	51,193	109.65	5,613,312.45	
	ノルウェークローネ 小計	495,008		98,716,257.29 (1,393,873,552)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	436.00	3,698,588.00	
	NOVOZYMES A/S	17,111	439.00	7,511,729.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,491.00	1,125,705.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	81,654	190.24	15,533,856.96	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	18,140.00	3,972,660.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	18,375.00	7,974,750.00	
	DSV A/S	15,307	1,134.50	17,365,791.50	
	PANDORA A/S	8,163	445.30	3,634,983.90	
	CARLSBERG AS-B	8,481	965.80	8,190,949.80	
	COLOPLAST-B	9,208	862.60	7,942,820.80	
	DEMANT A/S	8,512	228.00	1,940,736.00	
	GN STORE NORD A/S	9,226	215.40	1,987,280.40	
	GENMAB A/S	5,250	2,684.00	14,091,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	136,910	819.50	112,197,745.00	
	DANSKE BANK A/S	56,132	97.82	5,490,832.24	
	TRYG A/S	29,772	171.55	5,107,386.60	
	ORSTED A/S	15,439	769.80	11,884,942.20	
	デンマーククローネ 小計	411,056		229,651,757.40 (4,241,667,959)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	35.62	734,804.98	
	SANTOS	265,406	7.91	2,099,361.46	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	26.15	335,059.95	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	158,086	35.95	5,683,191.70	
	BHP GROUP LTD	414,748	42.81	17,755,361.88	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	17.42	605,693.40	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	2.50	305,385.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	19.87	2,753,823.04	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	34.66	1,280,617.68	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	65.12	938,314.08	
	NEWCREST MINING LIMITED	73,939	18.24	1,348,647.36	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	7.58	770,340.24	

	ORICA LTD	38,288	15.60	597,292.80
	RIO TINTO LTD	28,818	98.66	2,843,183.88
	SOUTH32 LTD	341,133	4.23	1,442,992.59
	REECE LTD	16,814	16.17	271,882.38
	BRAMBLES LTD	108,007	12.64	1,365,208.48
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.78	452,053.98
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.18	440,300.00
	TRANSURBAN GROUP	249,674	13.88	3,465,475.12
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	35.96	1,661,711.60
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	66.11	234,095.51
	IDP EDUCATION LTD	17,793	28.89	514,039.77
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.39	799,037.07
	REA GROUP LTD	3,586	128.34	460,227.24
	SEEK LTD	28,001	21.34	597,541.34
	WESFARMERS LTD	91,917	47.95	4,407,420.15
	COLES GROUP LTD	108,486	17.65	1,914,777.90
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.24	795,683.24
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	36.76	3,672,360.76
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	13.38	855,784.80
	COCHLEAR LIMITED	4,783	214.85	1,027,627.55
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	70.50	1,145,484.00
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	35.63	1,327,253.13
	CSL LIMITED	38,619	295.50	11,411,914.50
	AUST AND NZ BANKING GROUP	247,511	22.96	5,682,852.56
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	139,969	98.31	13,760,352.39
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	267,570	30.61	8,190,317.70
	WESTPAC BANKING	283,793	21.68	6,152,632.24
	ASX LTD	14,549	79.90	1,162,465.10
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,434	178.50	5,253,969.00
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	236,496	4.60	1,087,881.60
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.70	859,077.10
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.33	1,375,917.03
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	10.91	1,034,966.24
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.62	1,092,537.12
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	59.12	815,915.12
	XERO LTD	11,340	88.02	998,146.80
	TELSTRA CORP	308,467	4.03	1,243,122.01
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	6.35	961,815.45
	オーストラリアドル 小計	5,421,068		125,985,916.02 (11,959,843,007)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.68	905,249.28
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	20.20	807,596.00

	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.27	912,331.86	
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.94	383,801.22	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.00	552,720.00	
	ニュージーランドドル 小計	506,126		3,561,698.36 (301,212,830)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	52.20	11,170,591.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	98.75	10,566,250.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	15.40	2,648,800.00	
	MTR CORP	125,000	40.35	5,043,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	22.75	2,730,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	44.25	7,699,500.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	17.04	3,373,920.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	16.06	2,765,532.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	23.20	3,384,880.00	
	WH GROUP LTD	658,301	5.43	3,574,574.43	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	27.25	7,670,875.00	
	HANG SENG BANK	59,400	124.40	7,389,360.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	328.80	31,499,040.00	
	AIA GROUP LTD	982,200	78.20	76,808,040.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	53.95	8,874,559.20	
	ESR GROUP LTD	157,000	20.60	3,234,200.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	13.16	2,276,680.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	26.45	3,312,280.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	25.95	3,538,931.25	
	SINO LAND CO	315,400	11.46	3,614,484.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	94.05	10,157,400.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	56.40	2,284,200.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	18.24	1,754,688.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	37.00	4,403,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	48.70	3,287,250.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	68.10	9,363,750.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	7.97	7,210,116.29	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	47.85	5,359,200.00	
	香港ドル 小計	6,162,153		244,995,851.97 (4,319,276,870)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	112,800	7.21	813,288.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.84	566,016.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.38	582,826.16	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.79	485,850.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.08	728,688.00	
	DBS GROUP	150,000	32.84	4,926,000.00	
	OCBC BANK	282,100	12.14	3,424,694.00	

	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	27.47	2,579,433.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.64	636,240.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.77	842,595.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.25	353,100.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.16	340,100.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.55	476,735.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.65	1,804,498.95	
	シンガポールドル 小計	2,774,575		18,560,064.11 (1,836,147,142)	
イスラエルシ ケル	ICL LTD	59,427	34.90	2,074,002.30	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	674.20	1,446,833.20	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	34.75	3,416,272.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	134,557	35.76	4,811,758.32	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	20.96	2,085,520.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	137.60	1,720,412.80	
	AZRIELI GROUP	4,323	277.80	1,200,929.40	
	NICE LTD	4,991	700.50	3,496,195.50	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	152.30	1,523,000.00	
	イスラエルシケル 小計	425,757		21,774,924.02 (915,230,541)	
	合 計	89,796,557		532,553,614,703 (532,553,614,703)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	アメリカド ル	AMC ENTERTAINMENT HLDGS 0% 21710819(PREF	38,290	248,885.00	
		アメリカドル 小計	38,290	248,885.00 (34,430,750)	
	オーストラ リアドル	APA GROUP	109,658	1,228,169.60	
		LENDLEASE GROUP	64,786	666,647.94	
	オーストラリアドル 小計	174,444	1,894,817.54 (179,875,029)		
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,455,300.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,326,400.00	
香港ドル 小計	535,500	4,781,700.00 (84,301,371)			
	投資信託受益証券合計	748,234	298,607,150 (298,607,150)		
投資証券	アメリカド ル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,110	1,913,380.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	905,557.24	

	AMERICAN TOWER CORPORATION	37,131	9,698,245.89
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	149,611	981,448.16
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,372,014.24
	BOSTON PROPERTIES	11,259	917,721.09
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,043,790.30
	CROWN CASTLE INC	35,305	6,122,240.05
	DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,935,201.37
	DUKE REALTY CORP	30,517	1,853,602.58
	EQUINIX INC	7,423	4,978,903.02
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,021,947.70
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,592	2,249,879.76
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,430,334.00
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	2,251,088.84
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	769,728.00
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,214,459.95
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,035,539.52
	INVITATION HOMES INC	46,840	1,746,195.20
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,265,902.02
	KIMCO REALTY CORP	47,897	1,040,322.84
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	749,038.92
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,598,826.60
	PROLOGIS INC	60,352	7,746,179.20
	PUBLIC STORAGE	12,922	4,451,887.44
	REALTY INCOME CORP	47,102	3,292,900.82
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	786,316.35
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,834,793.24
	SIMON PROPERTY GROUP	27,091	2,840,491.35
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,450,581.30
	UDR INC	24,265	1,124,925.40
	VENTAS INC	31,565	1,524,589.50
	VICI PROPERTIES INC	75,321	2,533,798.44
	VORNADO REALTY TRUST	11,390	308,099.50
	WELLTOWER INC	35,629	2,755,190.57
	WP CAREY INC	16,024	1,373,737.52
	アメリカドル 小計	1,092,149	83,118,857.92 (11,498,662,804)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	220,648.05
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	319,868.50
	カナダドル 小計	20,377	540,516.55 (57,235,297)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	274,150.50
	GECINA SA	3,139	283,608.65



	KLEPIERRE	17,225	352,423.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	539,164.35	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	401,883.68	
	ユーロ 小計	48,695	1,851,230.68 (254,285,046)	
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	342,830.23	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,289	301,248.81	
	SEGRO PLC	93,383	902,640.07	
	イギリスポンド 小計	219,086	1,546,719.11 (249,918,873)	
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	833,637.40	
	GOODMAN GROUP	133,807	2,745,719.64	
	GPT GROUP	167,884	711,828.16	
	MIRVAC GROUP	266,683	560,034.30	
	SCENTRE GROUP	382,183	1,108,330.70	
	STOCKLAND	207,412	761,202.04	
	VICINITY CENTERS	365,149	697,434.59	
	オーストラリアドル 小計	1,617,208	7,418,186.83 (704,208,475)	
香港ドル	LINK REIT	170,500	10,528,375.00	
	香港ドル 小計	170,500	10,528,375.00 (185,615,251)	
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	818,317.44	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	708,092.32	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	504,076.42	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	411,400.00	
	シンガポールドル 小計	1,127,756	2,441,886.18 (241,575,799)	
	投資証券合計	4,295,771	13,191,501,545 (13,191,501,545)	
	合計		13,490,108,695 (13,490,108,695)	

(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%			72.5%
	投資信託受 益証券	1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券	36銘柄			2.8%	2.1%
カナダドル	株式	86銘柄	99.7%			3.7%
	投資証券	2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式	223銘柄	99.4%			8.4%
	投資証券	5銘柄			0.6%	0.0%
イギリスポンド	株式	79銘柄	99.0%			4.4%
	投資証券	3銘柄			1.0%	0.0%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.0%			2.9%
スウェーデンクローナ	株式	47銘柄	100.0%			0.9%
ノルウェークローネ	株式	12銘柄	100.0%			0.3%
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	93.1%			2.2%
	投資信託受 益証券	2銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券	7銘柄			5.5%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	28銘柄	94.1%			0.8%
	投資信託受 益証券	2銘柄		1.8%		0.0%
	投資証券	1銘柄			4.0%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	88.4%			0.3%
	投資証券	4銘柄			11.6%	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。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 8月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2022年 8月29日現在
項目	金額（円）
流動資産	
預金	5,552,102,939
コール・ローン	165,543,175
株式	108,655,620,952
投資信託受益証券	256,939,937
投資証券	106,825,406
派生商品評価勘定	22,619,842
未収入金	725,601
未収配当金	450,056,108
前払金	47,904,376
差入委託証拠金	620,012,636
流動資産合計	115,878,350,972
資産合計	115,878,350,972
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	69,006,388
未払金	3,414,323
未払解約金	27,581,627
未払利息	276
流動負債合計	100,002,614
負債合計	100,002,614
純資産の部	
元本等	
元本	31,545,220,148
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	84,233,128,210
元本等合計	115,778,348,358
純資産合計	115,778,348,358
負債純資産合計	115,878,350,972

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 8月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

2022年 8月29日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2022年 8月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	31,545,220,148口

		2022年 8月29日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.6702円 (36,702円)	

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		2022年 8月29日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。		
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。		

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		2022年 8月29日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>		

	2022年 8月29日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	27,325,267,766円
期中追加設定元本額	5,162,149,838円
期中一部解約元本額	942,197,456円
期末元本額	31,545,220,148円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,951,848,248円
世界経済インデックスファンド	6,215,339,270円
DC新興国株式インデックス・オープン	5,509,453,283円
DC世界経済インデックスファンド	5,501,164,004円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	152,313,943円
分散投資コア戦略ファンドA	234,719,161円
分散投資コア戦略ファンドS	1,319,362,044円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	765,559,477円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	624,268,999円

区分	2022年 8月29日現在
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	340,119,960円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	16,496,509円
S M T インデックスバランス・オープン	83,877,175円
S M T 世界経済インデックス・オープン	169,254,405円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	670,218,247円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	114,193,392円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	4,757,397円
グローバル経済コア	361,219,294円
M y S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	53,697,483円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	29,668,579円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	24,801,771円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	9,435,952円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	13,561,919円
10資産分散投資ファンド	4,133円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,121,307,076円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	193,022,105円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	56,711,922円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	8,844,400円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 8月29日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	18,891,350,841
投資信託受益証券	4,660,524
投資証券	3,957,127
合計	18,890,647,444

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2022年 8月29日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,233,075,082	-	47,904,376
			7,185,170,706	47,904,376
合計		7,233,075,082	-	47,904,376

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2022年 8月29日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	581,929,590	-	583,503,286	1,573,696
	アメリカドル	449,499,590	-	449,522,886	23,296
	香港ドル	132,430,000	-	133,980,400	1,550,400
	売建	2,693,690	-	2,749,556	55,866
	ブラジルリアル	2,693,690	-	2,749,556	55,866
合計		584,623,280	-	586,252,842	1,517,830

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.71	239,210.40	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	29,910	0.00	-	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	5.45	92,268.50	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	-	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	171	0.00	-	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	-	
	SOUTHERN COPPER CORP	11,571	51.37	594,402.27	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	53,727	25.66	1,378,634.82	
	LI AUTO INC - ADR	67,571	30.30	2,047,401.30	



	NIO INC - ADR	160,649	19.92	3,200,128.08	
	XPENG INC - ADR	53,231	18.92	1,007,130.52	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	19,163	40.31	772,460.53	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	5.99	245,937.42	
	TRIP.COM GROUP LTD	67,056	28.87	1,935,906.72	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	50,479	49.45	2,496,186.55	
	AUTOHOME INC-ADR	6,571	36.97	242,929.87	
	IQIYI INC-ADR	28,984	3.94	114,196.96	
	JOYY INC	6,185	32.43	200,579.55	
	KANZHUN LTD	6,900	24.23	167,187.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	5.06	574,547.82	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	20.61	108,181.89	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	-	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-	
	PINDUODUO INC-ADR	53,748	57.57	3,094,272.36	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	11.23	592,550.95	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	-	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	68,136	1.48	100,841.28	
	BEIGENE LTD-ADR	4,929	181.09	892,592.61	
	HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	12.41	89,885.63	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	3,311	45.50	150,650.50	
	ZAI LAB LTD-ADR	12,825	46.58	597,388.50	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	189,281	1.89	357,741.09	
	CREDICORP LTD	8,778	130.88	1,148,864.64	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-	
	360 DIGITECH INC	8,061	16.47	132,764.67	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	4.37	498,761.21	
	KE HOLDINGS INC	35,144	18.20	639,620.80	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.85	130,786.65	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	24,700	3.13	77,311.00	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	71.87	563,101.45	
	アメリカドル 小計	1,734,111		24,484,423.54 (3,387,175,152)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,063,461	8.09	16,693,399.49	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	377,892	80.64	30,473,210.88	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	172.32	2,498,640.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	40.99	3,969,963.48	
	ALFA S.A.B. -A	313,500	13.74	4,307,490.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	75.79	2,842,125.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	443.29	10,330,873.45	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	302.74	13,223,683.20	

	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	148.14	6,323,355.90	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	288,490	27.44	7,916,165.60	
	WALMART DE MEXICO-SER V	567,680	68.93	39,130,182.40	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	139.52	7,042,272.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	242,440	129.47	31,388,706.80	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	234.21	6,080,091.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	73.23	13,313,214.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	29.49	5,361,282.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	324,600	123.86	40,204,956.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	252,500	35.25	8,900,625.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,513,640	18.08	63,526,611.20	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	74,800	21.63	1,617,924.00	
	メキシコペソ 小計	8,717,560		315,144,772.00 (2,172,198,369)	
ブラジルリアル	COSAN SA	118,300	20.31	2,402,673.00	
	PETRO RIO SA	84,700	26.56	2,249,632.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	475,700	37.46	17,819,722.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	544,440	33.64	18,314,961.60	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	14.03	1,060,668.00	
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	32.52	627,636.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	15.01	1,491,994.00	
	GERDAU SA-PREF	141,800	24.06	3,411,708.00	
	SUZANO SA	90,079	45.35	4,085,082.65	
	VALE SA	477,787	68.23	32,599,407.01	
	WEG SA	217,544	28.81	6,267,442.64	
	CCR SA	125,600	13.86	1,740,816.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	75,752	61.55	4,662,535.60	
	RUMO SA	159,700	20.03	3,198,791.00	
	AMERICANAS SA	73,040	18.10	1,322,024.00	
	LOJAS RENNER S.A.	115,947	27.80	3,223,326.60	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	4.58	1,399,190.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	18.41	3,184,930.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	20.06	832,490.00	
	RAIA DROGASIL SA	122,500	22.19	2,718,275.00	
	AMBEV SA	628,600	15.67	9,850,162.00	
	BRF SA	52,500	16.53	867,825.00	
	JBS SA	110,000	29.95	3,294,500.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	15.52	1,556,780.16	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	510,254	8.06	4,112,647.24	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,600	33.46	1,525,776.00	
	HYPERA SA	54,500	43.26	2,357,670.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	261,323	16.09	4,204,687.07	

	BANCO BRADESCO SA-PREF	584,982	19.44	11,372,050.08	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	41.59	3,672,397.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	575,881	26.69	15,370,263.89	
	ITAUSA SA	528,325	9.35	4,939,838.75	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	715,509	12.43	8,893,776.87	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	28.40	1,959,600.00	
	TOTVS SA	57,900	29.49	1,707,471.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	42.24	2,209,152.00	
	TIM SA	96,100	11.91	1,144,551.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	47.53	1,758,610.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	105,500	46.35	4,889,925.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	12.32	2,609,708.64	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	47.67	2,407,335.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	35.30	960,160.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	40.50	1,873,125.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	23.99	3,960,749.00	
	ブラジルリアル 小計	8,711,948		210,112,065.80	(5,738,244,561)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	7,700.00	344,421,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,739.40	236,497,521.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	18,037	93,855.00	1,692,862,635.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	84.20	207,232,029.60	
	FALABELLA SA	70,837	2,121.50	150,280,695.50	
	CENCOSUD SA	137,988	1,266.00	174,692,808.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	5,035.00	37,183,475.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	86.99	423,001,053.60	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,718	28,090.00	160,618,620.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	35.25	221,363,690.25	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	98.76	344,802,269.40	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	28.70	73,508,678.60	
	チリペソ 小計	20,076,902		4,066,464,475.95	(629,679,824)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,418.00	1,182,351,222.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	37,950.00	1,114,819,200.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	33,500.00	2,062,427,500.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	20,020.00	1,011,230,220.00	
	コロンビアペソ 小計	630,431		5,370,828,142.00	(168,729,936)
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	9,898	16.32	161,535.36	
	OPAP SA	18,496	13.84	255,984.64	
	JUMBO SA	19,341	15.06	291,275.46	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	0.98	260,187.58	

	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	0.96	273,669.64
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	3.40	250,376.00
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	17.05	446,829.35
	PUBLIC POWER CORP	20,834	5.63	117,399.59
	ユーロ 小計	714,859		2,057,257.62 (282,584,906)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	343.70	3,987,951.10
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	29.50	3,444,272.50
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	26.70	2,658,412.20
	KOC HOLDING AS	89,884	47.00	4,224,548.00
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	24.50	7,319,326.00
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	69.70	6,037,065.50
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	338.90	2,203,188.90
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	112.90	4,834,829.60
	AKBANK T.A.S.	276,321	11.98	3,310,325.58
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	25.44	5,377,303.68
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	7.73	2,971,898.99
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	21.58	3,087,903.78
	トルコリラ 小計	1,767,743		49,457,025.83 (376,753,731)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	22,644	604.00	13,676,976.00
	CEZ AS	13,098	1,010.00	13,228,980.00
	チェココルナ 小計	35,742		26,905,956.00 (150,256,311)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,808.00	125,020,584.00
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	8,180.00	124,156,040.00
	OTP BANK NYRT	38,695	9,180.00	355,220,100.00
	ハンガリーフォリント 小計	98,396		604,396,724.00 (201,464,164)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	62.50	1,919,562.50
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	200,051	5.71	1,142,691.31
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	102.95	2,078,148.70
	LPP SA	124	9,595.00	1,189,780.00
	CD PROJEKT SA	6,704	84.00	563,136.00
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	20.16	727,735.68
	ALLEGRO.EU SA	39,203	25.21	988,307.63
	DINO POLSKA SA	5,945	382.60	2,274,557.00
	BANK PEKAO SA	27,684	67.14	1,858,703.76
	M BANK SA	1,423	227.00	323,021.00
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	23.56	3,069,797.32
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	227.60	1,671,266.80
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	48,568	28.52	1,385,159.36

	ORANGE POLSKA SA	55,658	6.09	339,291.16
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	7.64	485,617.40
	ポーランドズロチ 小計	673,493		20,016,775.62 (579,333,526)
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	1,310,610	0.00	0.13
	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	-
	NOVATEK PJSC	105,900	0.00	0.01
	ROSNEFT OIL CO PJSC	134,073	0.00	0.01
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,232,060	0.00	0.12
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	7,220	0.00	-
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	195,980	0.00	0.01
	PHOSAGRO PJSC	8,882	0.00	-
	POLYUS PJSC	3,969	0.00	-
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	-
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11
	VTB BANK PJSC	756,074,000	0.00	75.60
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	-
	ロシアルーブル 小計	760,345,896		75.99 (174)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	7.22	2,375,380.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	116,000	8.25	957,000.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,915,400	3.82	11,136,828.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	460,000	25.55	11,753,000.00
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	236,000	3.63	856,680.00
	PETROCHINA CO LTD-H	2,648,000	3.77	9,982,960.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	142,000	31.60	4,487,200.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.07	1,043,800.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	30.85	4,457,825.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	8.43	1,846,170.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	7.72	3,180,640.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	4.92	1,416,960.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	3.74	3,029,400.00
	DONGYUE GROUP	147,000	9.12	1,340,640.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	54,040	73.40	3,966,536.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	67,000	10.22	684,740.00
	MMG LIMITED	304,000	2.27	690,080.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	6.22	802,380.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	4,750	13.64	64,790.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	6.75	1,221,750.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	9.42	6,867,180.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.94	1,083,500.00	
BOC AVIATION LTD	23,800	65.20	1,551,760.00	

CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.37	660,520.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	16.44	3,994,920.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	9.90	1,267,200.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	4.44	3,134,640.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	9.30	1,581,000.00
CITIC LTD	617,000	8.21	5,065,570.00
CRRG CORP LTD-H	409,000	2.86	1,169,740.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	6.01	1,730,880.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	18.86	1,471,080.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	8.12	1,299,200.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	8.56	466,520.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	211,800	10.76	2,278,968.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	12.10	1,708,713.60
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	36.70	2,286,410.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	3.63	421,806.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	3.91	1,505,639.34
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	6.45	1,380,300.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.99	1,237,520.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	12.26	2,029,606.22
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.26	749,760.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	11.48	5,947,214.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	5.12	1,283,962.88
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	6.91	2,225,020.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	219.80	3,846,500.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	6.96	991,013.52
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.97	1,850,700.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	5.47	2,014,800.00
BYD CO LTD-H	102,000	265.00	27,030,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	5.20	1,383,200.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	36.80	2,149,120.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	758,000	16.16	12,249,280.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	12.48	4,402,320.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	6.92	2,479,740.48
MINTH GROUP LTD	64,000	23.80	1,523,200.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	15.36	1,658,880.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	151,600	96.65	14,652,140.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	4.41	1,931,580.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	303,000	24.20	7,332,600.00
LI NING CO LTD	292,000	71.35	20,834,200.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	99,600	83.75	8,341,500.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	10.88	1,795,200.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	17.66	2,048,560.00

JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	17.28	984,960.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	21.95	5,366,775.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	68,400	16.80	1,149,120.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.62	899,000.00
BAIDU INC-CLASS A	267,900	145.40	38,952,660.00
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	201.40	5,357,240.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	31.50	1,625,400.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	268,000	2.04	546,720.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	23.60	2,171,200.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	211,600	70.75	14,970,700.00
NETEASE INC	246,830	142.40	35,148,592.00
TENCENT HOLDINGS LTD	748,300	324.20	242,598,860.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,830,888	95.80	175,399,070.40
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	4.56	1,924,320.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	17.28	1,797,120.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	123,550	56.95	7,036,172.50
JD.COM INC - CL A	237,411	248.40	58,972,892.40
MEITUAN-CLASS B	495,300	181.90	90,095,070.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	21.50	1,154,550.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	19.52	1,260,992.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	6.18	704,520.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	41.15	3,785,800.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	120.85	1,836,920.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	6.59	3,716,760.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	402,000	36.20	14,552,400.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	182,000	56.85	10,346,700.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.65	897,900.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	193,000	46.90	9,051,700.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	14.96	2,917,200.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	13.78	3,141,840.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	68,000	77.15	5,246,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.82	545,600.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.63	3,152,800.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	22.80	1,094,400.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	37.80	3,307,500.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	22.60	565,000.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	35,200	45.00	1,584,000.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	5.27	653,480.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	18.46	1,218,360.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	10.00	3,992,000.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	10.86	1,394,424.00

SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	17.62	3,368,944.00
3SBIO INC	119,000	5.15	612,850.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	61.50	615,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	11.86	2,929,420.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,144,160	8.04	9,199,046.40
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.25	1,579,500.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	26.45	3,491,400.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	77.05	392,955.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	17.20	2,098,400.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	139,000	34.90	4,851,100.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	52.35	1,751,107.50
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	25.40	1,854,200.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	4.18	4,652,340.00
WUXI APPTec CO LTD-H	42,288	90.45	3,824,949.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	423,000	72.05	30,477,150.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,441,000	2.58	8,877,780.00
BANK OF CHINA LTD-H	9,806,200	2.74	26,868,988.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.61	5,063,969.75
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.32	3,157,984.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	11,210,620	4.89	54,819,931.80
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.39	896,250.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	455,923	40.60	18,510,473.80
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.56	1,726,464.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	6,699,515	4.04	27,066,040.60
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	4.76	5,040,840.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.10	915,200.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.15	2,004,450.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	203,600	14.52	2,956,272.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	16.26	4,646,701.50
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.13	1,471,200.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	10.30	912,580.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.30	1,893,160.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	10.58	1,434,648.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	918,000	11.38	10,446,840.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	16.40	6,340,240.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.07	1,485,073.68
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	18.52	1,785,328.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.34	2,197,260.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	7.76	5,348,874.88
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	784,500	46.65	36,596,925.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	22.25	1,016,825.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	104,500	8.10	846,450.00



CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	1.66	959,480.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	468,540	21.35	10,003,329.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	7.80	1,755,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	367,111	32.20	11,820,974.20
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	67,600	33.75	2,281,500.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	14.80	2,640,320.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	64,000	5.70	364,800.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	586,560	2.70	1,583,712.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,016,654	2.63	2,673,800.02
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	232,000	16.08	3,730,560.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	15.02	1,088,950.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	6.75	1,215,000.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	72,600	10.18	739,068.00
LONGFOR PROPERTIES	229,000	26.70	6,114,300.00
SEAZEN GROUP LTD	768,000	2.86	2,196,480.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00
WHARF HOLDINGS	154,000	28.65	4,412,100.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	9.93	1,147,908.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	6.17	1,702,920.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	27.75	3,515,925.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	15.54	4,832,940.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	88,000	6.17	542,960.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	14.08	1,112,320.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	14.72	1,052,480.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	20.70	1,252,350.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	22.85	1,530,950.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.31	504,390.00
LENOVO GROUP LTD	900,000	6.88	6,192,000.00
SUNNY OPTICAL TECH	92,900	111.50	10,358,350.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,906,200	11.78	22,455,036.00
ZTE CORP-H	82,908	16.32	1,353,058.56
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	0.99	4,520,340.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	23.75	1,413,125.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.05	1,250,500.00
CGN POWER CO LTD-H	791,000	1.87	1,479,170.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	11.00	5,130,400.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	13.04	5,894,080.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	4.20	2,797,200.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	30.70	3,254,200.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	16.16	4,159,584.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	98,600	118.00	11,634,800.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	7.32	3,264,720.00

	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.23	2,977,920.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	6.90	3,781,200.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	26.05	1,667,200.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	24.10	2,169,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	625,987	11.60	7,261,449.20	
	香港ドル 小計	100,322,189		1,479,723,452.83 (26,087,524,473)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.39	988,666.52	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	21.42	537,642.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	8.69	2,345,431.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	4.70	1,356,420.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.25	276,950.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.35	790,413.10	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	6.02	641,695.88	
	MISC BHD	125,040	7.10	887,784.00	
	GENTING BHD	271,600	4.72	1,281,952.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.97	1,098,009.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	2.09	634,210.50	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	4.17	1,127,317.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	50,646	22.30	1,129,405.80	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	135.80	977,760.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	16.78	1,232,994.40	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.10	636,480.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.27	1,054,886.42	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	181,300	1.67	302,771.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.37	1,460,641.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	0.83	419,067.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	4.05	1,217,835.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	923,175	5.46	5,040,535.50	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	20.68	1,267,518.56	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	19.30	321,016.90	
	MALAYAN BANKING BHD	571,105	8.91	5,088,545.55	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,675,000	4.63	7,755,250.00	
	RHB BANK BHD	214,897	5.79	1,244,253.63	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.03	864,425.67	
DIGI.COM BERHAD	311,700	3.75	1,168,875.00		
MAXIS BHD	267,900	3.91	1,047,489.00		
TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	6.00	1,629,312.00		
PETRONAS GAS BHD	75,500	17.52	1,322,760.00		
TENAGA NATIONAL BHD	305,275	8.76	2,674,209.00		
INARI AMERTRON BHD	274,700	2.78	763,666.00		

	マレーシアリングット 小計	9,791,928		50,586,189.23 (1,561,317,437)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	167.50	33,634,000.00
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	38.00	45,501,200.00
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	61.00	7,326,100.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	45.50	9,391,200.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	47.75	23,212,898.50
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	56.75	5,709,050.00
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	102,600	361.00	37,038,600.00
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	527,000	72.25	38,075,750.00
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.90	7,271,300.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	8.40	6,799,800.00
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	5.50	4,456,650.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.00	11,970,354.00
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	40.00	7,288,000.00
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	13.90	11,677,876.50
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	27.00	7,803,000.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	33.75	5,994,000.00
	CP ALL PCL-NVDR	691,700	61.75	42,712,475.00
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	103.00	4,768,900.00
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	26.00	14,466,400.00
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	31.25	2,062,500.00
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	17.30	3,198,770.00
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	28.00	32,953,200.00
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	216.00	17,863,200.00
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	16.60	7,281,590.00
	SCB X PCL-NVDR	88,700	110.50	9,801,350.00
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	18.20	3,004,820.00
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	72,600	76.75	5,572,050.00
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	59.50	6,039,250.00
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	44.00	3,951,200.00
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	50.75	3,872,225.00
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	66.25	14,992,375.00
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.70	7,586,400.00
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	578.00	22,484,200.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	192.50	23,042,250.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	72.25	8,803,662.50	
TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	4.60	4,422,481.40	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	36.25	1,935,750.00	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	181.00	3,058,900.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	83.00	18,251,700.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	67.00	4,569,400.00	

	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	51.50	20,749,350.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	81,450	43.75	3,563,437.50	
	タイパーツ 小計	14,249,966		554,157,615.40 (2,105,798,938)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	59.00	14,038,460.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	720.00	20,361,600.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	494.00	3,387,852.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	54.50	16,541,458.50	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	879.00	31,894,515.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	186.50	28,558,745.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	237.00	14,459,370.00	
	MONDE NISSIN CORP	490,500	16.00	7,848,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	126.30	12,069,228.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	96.95	20,603,329.25	
	BDO UNIBANK INC	219,911	131.50	28,918,296.50	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	53.45	8,620,790.15	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.73	8,786,761.00	
	AYALA LAND INC	794,100	29.30	23,267,130.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,567,750	37.05	58,085,137.50	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	320,000	18.60	5,952,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,220.00	10,411,800.00	
	PLDT INC	10,460	1,711.00	17,897,060.00	
ACEN CORP	821,840	8.04	6,607,593.60		
MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	313.80	16,687,884.00		
	フィリピンペソ 小計	7,934,509		354,997,010.50 (876,310,120)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	3,410.00	7,373,443,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	33,100.00	6,649,790,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	964,000	1,660.00	1,600,240,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,955.00	1,927,239,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	825.00	2,378,062,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,250.00	2,014,650,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	4,160.00	6,752,915,520.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	6,125.00	1,863,225,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	6,550.00	2,263,680,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,542,000	6,875.00	17,476,250,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,020.00	4,320,174,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	5,875.00	4,654,762,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	25,025.00	1,491,490,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,725.00	1,404,725,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,500.00	2,789,150,000.00	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	4,610.00	3,440,904,000.00		

	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,620.00	6,785,370,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	6,769,300	8,000.00	54,154,400,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	474,900	8,775.00	4,167,247,500.00	
	BANK MANDIRI	2,163,796	8,500.00	18,392,266,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,300.00	6,724,660,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	8,237,202	4,270.00	35,172,852,540.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,235.00	3,508,141,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,601,300	4,490.00	25,149,837,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	2,910.00	3,131,451,000.00	
	インドネシアルピア 小計	48,743,795		225,586,925,560.00 (2,120,517,100)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	62,500.00	323,750,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	106,500.00	680,215,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,766	203,500.00	1,376,881,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	51,300.00	635,145,300.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	33,050.00	369,796,450.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	585,000.00	704,340,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	131,500.00	249,587,000.00	
	LG CHEM LTD	5,774	616,000.00	3,556,784,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	293,500.00	257,399,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	180,500.00	348,365,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	163,500.00	547,725,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	9,290	249,000.00	2,313,210,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,122	101,000.00	113,322,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	83,000.00	194,054,000.00	
	SKC CO LTD	1,734	125,500.00	217,617,000.00	
	CJ CORP	1,230	78,000.00	95,940,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	35,350.00	152,287,800.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	42,494	22,150.00	941,242,100.00	
	ECOPRO BM CO LTD	4,680	114,200.00	534,456,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	30,900.00	208,884,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	45,350.00	298,992,550.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	48,900.00	477,655,200.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	149,500.00	316,192,500.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,828	59,400.00	346,183,200.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	98,800.00	430,175,200.00	
	LG CORP	11,686	83,100.00	971,106,600.00	
	LG ENERGY SOLUTION	2,553	465,500.00	1,188,421,500.00	
	SAMSUNG C&T CORP	11,910	122,500.00	1,458,975,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	23,950.00	443,458,200.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	6,150.00	585,289,350.00	
	SK INC	4,545	233,500.00	1,061,257,500.00	

S-1 CORPORATION	3,573	59,300.00	211,878,900.00
CJ LOGISTICS	862	121,500.00	104,733,000.00
HMM CO LTD	35,545	23,200.00	824,644,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	178,000.00	497,154,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	23,739	26,350.00	625,522,650.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,470.00	162,655,920.00
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	37,100.00	262,148,600.00
HANON SYSTEMS	19,000	10,300.00	195,700,000.00
HYUNDAI MOBIS	7,116	212,500.00	1,512,150,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	16,824	193,500.00	3,255,444,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	91,900.00	280,386,900.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	91,000.00	313,859,000.00
KIA CORP	29,259	78,900.00	2,308,535,100.00
COWAY CO LTD	9,036	63,400.00	572,882,400.00
F&F CO LTD / NEW	3,017	143,000.00	431,431,000.00
HLB INC	10,012	46,950.00	470,063,400.00
LG ELECTRONICS INC	13,527	100,500.00	1,359,463,500.00
KANGWON LAND INC	7,703	26,500.00	204,129,500.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	9,880	22,100.00	218,348,000.00
CJ ENM CO LTD	830	96,500.00	80,095,000.00
HYBE CO LTD	2,474	175,500.00	434,187,000.00
KAKAO CORP	37,877	76,000.00	2,878,652,000.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	52,200.00	157,696,200.00
KRAFTON INC	3,554	244,500.00	868,953,000.00
NAVER CORP	15,839	242,000.00	3,833,038,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,939	368,500.00	714,521,500.00
NETMARBLE CORP	2,465	63,400.00	156,281,000.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	55,900.00	257,419,500.00
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	73,000.00	318,499,000.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	100,500.00	103,917,000.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	160,500.00	261,936,000.00
EMART	3,594	100,500.00	361,197,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	414,500.00	321,237,500.00
KT&G CORP	18,829	82,600.00	1,555,275,400.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	99,600.00	312,943,200.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	124,000.00	466,488,000.00
LG H&H CO LTD	956	702,000.00	671,112,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	389	356,500.00	138,678,500.00
PACIFIC CORP	3,393	34,850.00	118,246,050.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,851	71,400.00	631,961,400.00
SD BIOSENSOR INC	3,909	34,850.00	136,228,650.00
ALTEOGEN INC	2,841	65,300.00	185,517,300.00

	CELLTRION INC	10,890	189,500.00	2,063,655,000.00	
	CELLTRION PHARM INC	1,968	78,400.00	154,291,200.00	
	GREEN CROSS CORP	564	159,500.00	89,958,000.00	
	HANMI PHARM CO LTD	1,156	300,000.00	346,800,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,993	847,000.00	1,688,071,000.00	
	SEEGENE INC	3,838	32,000.00	122,816,000.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	71,000.00	226,987,000.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	114,000.00	239,400,000.00	
	YUHAN CORPORATION	12,567	57,000.00	716,319,000.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	33,962	39,050.00	1,326,216,100.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	9,720.00	275,367,600.00	
	KAKAObANK CORP	18,421	28,100.00	517,630,100.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	48,657	50,100.00	2,437,715,700.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	50,883	36,350.00	1,849,597,050.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	12,300.00	730,693,800.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	58,500.00	269,217,000.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	7,939	29,550.00	234,597,450.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,910.00	235,208,640.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,610.00	205,009,150.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	10,000.00	121,070,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	34,500.00	199,272,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	60,600.00	255,065,400.00	
	MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	7,329	37,300.00	273,371,700.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	196,500.00	610,722,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	62,200.00	461,337,400.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	129,500.00	482,387,500.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	2,166	73,000.00	158,118,000.00	
	L&F CO LTD	3,026	230,500.00	697,493,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	15,400.00	370,693,400.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	343,000.00	485,345,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,845	138,500.00	948,032,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	573,964	60,000.00	34,437,840,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	96,421	55,100.00	5,312,797,100.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,526	586,000.00	3,824,236,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	12,050.00	266,606,250.00	
	SK TELECOM	9,599	51,300.00	492,428,700.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	20,850.00	551,670,150.00	
	SK HYNIX INC	65,667	95,100.00	6,244,931,700.00	
	SK SQUARE CO LTD	11,660	41,100.00	479,226,000.00	
	韓国ウォン 小計	1,932,198		120,576,112,110.00 (12,407,281,936)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	86.40	9,697,536.00	

ASIA CEMENT CORP	234,176	42.80	10,022,732.80
CHINA STEEL	1,494,261	29.25	43,707,134.25
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	69.90	29,362,263.90
FORMOSA PLASTICS CORP	441,824	93.20	41,177,996.80
NAN YA PLASTICS CORP	647,752	70.20	45,472,190.40
TAIWAN CEMENT	648,419	39.65	25,709,813.35
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	830.00	15,402,310.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	31.65	11,015,086.20
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,740.00	15,660,000.00
WALSIN LIHWA CORP	309,213	38.95	12,043,846.35
CHINA AIRLINES LTD	183,000	22.90	4,190,700.00
EVA AIRWAYS CORP	386,000	34.15	13,181,900.00
EVERGREEN MARINE	308,039	93.50	28,801,646.50
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	28.95	13,664,400.00
WAN HAI LINES LIMITED	74,635	93.10	6,948,518.50
YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	83.40	18,097,800.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	35.35	6,259,106.35
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	457.50	9,121,177.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	173.50	12,222,728.00
GIANT MANUFACTURING	34,464	251.50	8,667,696.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	295.50	9,160,500.00
POU CHEN	273,780	29.25	8,008,065.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	42,000	607.00	25,494,000.00
MOMO.COM INC	6,000	751.00	4,506,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	272.00	24,083,968.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	645,395	66.40	42,854,228.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	593,540	17.65	10,475,981.00
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,011,237	23.85	47,968,002.45
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,491,629	28.00	41,765,612.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,273,202	26.65	33,930,833.30
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,095,361	23.20	25,412,375.20
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,241,622	35.85	44,512,148.70
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,168,457	17.45	20,389,574.65
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,348,011	15.60	21,028,971.60
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,110,787	27.45	30,491,103.15
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	451,861	50.40	22,773,794.40
CHAILEASE HOLDING CO LTD	151,375	220.00	33,302,500.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,389,633	20.40	28,348,513.20
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	46.75	41,519,750.25
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,896,226	13.75	26,073,107.50
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	909,435	58.50	53,201,947.50
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,262,866	9.01	11,378,422.66



RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	206,724	64.30	13,292,353.20
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	285.50	13,704,000.00
ACER INC	255,803	22.40	5,729,987.20
ADVANTECH CO LTD	43,336	328.00	14,214,208.00
ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	258.50	18,635,782.00
AUO CORP	945,090	16.15	15,263,203.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	183.00	21,722,100.00
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,049,000	11.90	12,483,100.00
COMPAL ELECTRONICS	431,760	23.00	9,930,480.00
DELTA ELECTRONICS INC	217,903	268.00	58,398,004.00
E INK HOLDINGS INC	94,000	240.00	22,560,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,510,248	110.50	166,882,404.00
INVENTEC CO LTD	280,511	23.75	6,662,136.25
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	1,985.00	29,854,400.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	65.10	14,676,925.20
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	116.50	6,990,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	278.00	5,838,000.00
PEGATRON CORP	200,474	64.20	12,870,430.80
QUANTA COMPUTER INC	286,270	79.00	22,615,330.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	56.00	11,317,600.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	141,000	156.50	22,066,500.00
WIWYNN CORP	8,000	776.00	6,208,000.00
WPG HOLDINGS LTD	260,692	51.00	13,295,292.00
YAGEO CORPORATION	54,764	332.00	18,181,648.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	114.00	15,723,108.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	505,315	122.00	61,648,430.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	74.90	16,178,400.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	99.90	24,495,480.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	359,315	87.50	31,440,062.50
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	990.00	2,970,000.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,410.00	8,460,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	500.00	12,000,000.00
MEDIATEK INC	179,804	678.00	121,907,112.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	53.50	6,152,500.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	74,045	265.00	19,621,925.00
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	912.00	7,296,000.00
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	301,000	34.85	10,489,850.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	353.50	21,897,204.00
SILERGY CORP	36,000	565.00	20,340,000.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,954,389	512.00	1,512,647,168.00
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,411,000	41.30	58,274,300.00
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	76.60	6,817,400.00

	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	169.50	5,424,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	22.60	7,887,400.00
	新台湾ドル 小計	39,852,092		3,502,168,205.11 (16,033,276,259)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	329.10	31,666,331.10
	COAL INDIA LTD	180,326	229.95	41,465,963.70
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	241.45	14,348,166.25
	INDIAN OIL CORP LTD	290,647	71.90	20,897,519.30
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	381,562	136.65	52,140,447.30
	PETRONET LNG LTD	83,779	219.15	18,360,167.85
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	367,287	2,618.00	961,557,366.00
	ACC LTD	5,315	2,285.50	12,147,432.50
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	402.85	29,622,769.05
	ASIAN PAINTS LTD	42,204	3,323.55	140,267,104.20
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	660.15	19,440,757.35
	GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,675.25	52,818,957.25
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	440.05	79,429,465.05
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	419.65	29,280,659.10
	JSW STEEL LTD	99,332	667.00	66,254,444.00
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,376.40	43,207,790.80
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,666.90	48,534,913.10
	SHREE CEMENT LTD	1,387	22,097.90	30,649,787.30
	SRF LTD	14,609	2,401.55	35,084,243.95
	TATA STEEL LTD	940,850	107.35	101,000,247.50
	ULTRATECH CEMENT LTD	11,556	6,517.15	75,312,185.40
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	760.00	52,934,760.00
	VEDANTA LTD	107,173	269.60	28,893,840.80
	ADANI ENTERPRISES LTD	34,272	3,139.55	107,598,657.60
	BHARAT ELECTRONICS LTD	169,135	305.35	51,645,372.25
	HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,323.65	47,209,300.90
	LARSEN & TOUBRO LTD	82,638	1,905.40	157,458,445.20
	SIEMENS INDIA LTD	11,025	2,920.05	32,193,551.25
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	718.65	16,523,919.45
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	64,743	837.70	54,235,211.10
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	712.65	18,853,155.75
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,974.70	16,508,492.00
BAJAJ AUTO LTD	9,644	4,054.40	39,100,633.60	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,047.45	18,081,030.95	
BHARAT FORGE LTD	30,322	732.80	22,219,961.60	
EICHER MOTORS LTD	14,685	3,355.10	49,269,643.50	
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,826.75	34,593,766.50	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	101,669	1,274.65	129,592,390.85	

MARUTI SUZUKI INDIA LTD	15,707	8,720.60	136,974,464.20
MRF LTD	432	85,272.25	36,837,612.00
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	124,426	124.85	15,534,586.10
TATA MOTORS LTD	190,082	465.05	88,397,634.10
PAGE INDUSTRIES LTD	886	49,937.60	44,244,713.60
TITAN INDUSTRIES LTD	46,501	2,532.90	117,782,382.90
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	591.00	25,962,630.00
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	4,436.45	34,848,314.75
TRENT LTD	19,255	1,390.60	26,776,003.00
ZOMATO LTD	170,264	61.85	10,530,828.40
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	4,409.65	77,274,706.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,474	3,650.15	41,881,821.10
ITC LTD	345,135	312.90	107,992,741.50
MARICO LTD	81,711	515.60	42,130,191.60
NESTLE INDIA LIMITED	3,906	19,528.10	76,276,758.60
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	801.95	48,929,375.35
UNITED SPIRITS LTD	32,483	810.65	26,332,343.95
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,571.25	15,030,577.50
DABUR INDIA LTD	58,111	572.00	33,239,492.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	897.80	56,916,928.80
HINDUSTAN UNILEVER LTD	97,997	2,571.55	252,004,185.35
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	13,485	4,215.25	56,842,646.25
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	549.85	19,472,937.75
BIOCON LTD	58,256	306.75	17,870,028.00
CIPLA LTD	49,816	1,020.80	50,852,172.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	3,587.50	53,030,425.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,223.30	53,399,405.20
LUPIN LTD	26,552	652.70	17,330,490.40
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	110,469	880.15	97,229,290.35
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,547.80	18,914,116.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	641.40	19,327,947.60
AXIS BANK LTD	273,120	744.90	203,447,088.00
BANDHAN BANK LTD	74,811	286.35	21,422,129.85
ICICI BANK LTD	618,625	870.85	538,729,581.25
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	73,561	1,902.05	139,916,700.05
STATE BANK OF INDIA	226,932	523.80	118,866,981.60
YES BANK LTD	1,020,164	16.45	16,781,697.80
BAJAJ FINANCE LTD	32,202	7,062.10	227,413,744.20
BAJAJ FINSERV LTD	5,500	16,286.00	89,573,000.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	796.20	30,687,936.60
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	214,032	2,396.70	512,970,494.40
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,047.45	13,012,471.35

	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	1,979.85	23,207,801.70
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	908.00	28,159,804.00
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,333.35	28,288,353.60
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	129,053	566.90	73,160,145.70
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,260.05	29,661,577.00
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	591.85	18,780,584.20
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,313.70	70,637,649.00
	DLF LTD	56,420	380.00	21,439,600.00
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,384.55	17,617,014.20
	HCL TECHNOLOGIES LTD	123,161	945.65	116,467,199.65
	INFOSYS LTD	396,083	1,521.55	602,660,088.65
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	4,658.95	26,816,916.20
	MINDTREE LTD	6,247	3,319.30	20,735,667.10
	MPHASIS LTD	7,796	2,166.05	16,886,525.80
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	106,835	3,222.20	344,243,737.00
	TATA ELXSI LTD	4,179	9,349.00	39,069,471.00
	TECH MAHINDRA LTD	72,109	1,085.55	78,277,924.95
	WIPRO LTD	179,580	417.25	74,929,755.00
	BHARTI AIRTEL LTD	294,891	730.85	215,521,087.35
	INDUS TOWERS LTD	90,578	200.80	18,188,062.40
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	2,392.75	101,883,295.00
	ADANI POWER LTD	85,623	375.50	32,151,436.50
	ADANI TOTAL GAS LTD	33,068	3,459.65	114,403,706.20
	ADANI TRANSMISSION LTD	32,827	3,751.20	123,140,642.40
	GAIL INDIA LTD	174,768	134.55	23,515,034.40
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	418.50	11,183,994.00
	NTPC LTD	664,141	163.40	108,520,639.40
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	327,337	230.45	75,434,811.65
	TATA POWER CO LTD	199,512	235.10	46,905,271.20
	インドルピー 小計	11,400,107		8,915,276,222.45 (15,512,580,627)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	19.27	1,154,542.78
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.04	1,901,936.77
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.65	1,176,401.25
	INDUSTRIES QATAR	196,788	18.68	3,675,999.84
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	7.59	1,550,120.01
	MASRAF AL RAYAN	732,376	4.58	3,360,141.08
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	12.04	1,186,650.36
	QATAR ISLAMIC BANK	185,298	26.25	4,864,072.50
	QATAR NATIONAL BANK	530,405	20.80	11,032,424.00
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.67	761,695.79
	OORED00 QSC	72,800	9.00	655,200.00

	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	19.50	1,881,984.00	
	カタールリアル 小計	3,297,787		33,201,168.38 (1,250,023,989)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	227.76	5,129,155.20	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	253.00	3,711,510.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	5,906	1,275.00	7,530,150.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	51,324	250.22	12,842,291.28	
	GOLD FIELDS LTD	97,102	149.56	14,522,575.12	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	54.18	3,050,388.18	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	114,090	189.54	21,624,618.60	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	436.62	2,345,522.64	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	32,710	172.31	5,636,260.10	
	SASOL LTD	72,299	348.02	25,161,497.98	
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	42.15	16,646,046.60	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	224.34	6,214,666.68	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	118.38	4,797,823.02	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	189.00	5,388,390.00	
	NASPERS LTD-N SHS	27,673	2,551.89	70,618,451.97	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	144,533	20.17	2,915,230.61	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	130.02	4,882,771.08	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	53.51	5,912,587.45	
	BID CORP LTD	35,017	337.14	11,805,631.38	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	301.45	10,677,961.90	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	60,003	235.73	14,144,507.19	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	158.70	3,693,583.80	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	145.01	8,146,951.82	
	ABSA GROUP LTD	95,814	188.99	18,107,887.86	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9,724	2,120.56	20,620,325.44	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	224.27	14,153,903.97	
	STANDARD BANK GROUP LTD	173,745	162.69	28,266,574.05	
	FIRSTRAND LTD	617,542	68.95	42,579,520.90	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	290.71	4,996,432.77	
	REMGRO LTD	55,441	133.87	7,421,886.67	
	DISCOVERY LIMITED	59,544	132.00	7,859,808.00	
OLD MUTUAL LTD	489,612	11.44	5,601,161.28		
SANLAM LTD	214,053	56.25	12,040,481.25		
NEPI ROCKCASTLE SA	60,556	93.06	5,635,341.36		
MTN GROUP LTD	194,516	132.45	25,763,644.20		
VODACOM GROUP	62,331	130.87	8,157,257.97		
	南アフリカランド 小計	3,607,288		468,602,798.32 (3,819,112,806)	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	4.69	2,082,463.18	

アラブ首長国連邦 ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	9.25	3,025,101.50	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	9.20	1,709,185.20	
	DUBAI ISLAMIC BANK	335,455	5.96	1,999,311.80	
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	13.70	3,702,562.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	492,228	20.20	9,943,005.60	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	487,034	5.00	2,435,170.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	576,832	6.10	3,518,675.20	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	404,510	26.08	10,549,620.80	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		3,523,160		38,965,095.28	(1,470,153,044)
クウェートディ ナール	AGILITY	157,695	0.85	134,040.75	
	BOUBYAN BANK K.S.C	152,875	0.85	131,013.87	
	GULF BANK	137,143	0.35	48,685.76	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	632,130	0.89	562,595.70	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	838,738	1.06	890,739.75	
	MABANEE CO KPSC	133,798	0.81	109,580.56	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.61	182,847.28	
クウェートディナール 小計		2,349,209		2,059,503.67	(927,456,287)
オフショア人民 元	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	31.26	625,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	5.44	544,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	22.64	2,177,968.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	13.85	1,102,460.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	17.42	1,529,476.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	39.88	1,116,640.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	20,700	49.94	1,033,758.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	4.70	772,210.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	31.81	936,486.40	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	5.33	206,271.00	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	56.86	1,171,316.00	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	78,847	20.86	1,644,748.42	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	300	14.66	4,398.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	30.84	641,472.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	11,200	89.91	1,006,992.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	50.28	1,248,251.28	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	19.33	717,143.00	
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	12,900	118.95	1,534,455.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	17.10	171,000.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	2.09	963,490.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.32	259,200.00		
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	21.16	471,868.00		
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	112.05	873,990.00		

KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	11.43	347,472.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	17.68	270,504.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	14.04	1,111,968.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	6.09	1,340,409.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	14.35	695,257.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	39,625	24.15	956,943.75
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	18.09	131,188.68
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	29.45	528,333.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.58	1,026,028.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	11,200	66.06	739,872.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	4.88	670,512.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	18.08	891,344.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	44.42	479,736.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	4,200	336.80	1,414,560.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	14.45	141,610.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.07	1,018,012.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	5.71	526,462.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	88.67	1,551,725.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	68.45	631,109.00
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	11,775	104.66	1,232,371.50
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	11.99	1,334,487.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	11,400	143.22	1,632,708.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	200.01	820,041.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	80.15	593,911.50
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	105,600	9.15	966,240.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	48.17	549,138.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	44.25	685,875.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	26.05	218,820.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	15.16	970,240.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	26.23	1,448,289.45
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.24	1,350,944.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.01	1,056,609.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	17,700	506.78	8,970,006.00
CRRG CORP LTD-A	185,800	4.92	914,136.00
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	101.30	767,144.90
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	6.90	157,320.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	10,200	261.44	2,666,688.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	38.23	221,734.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	90.75	571,725.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	39.50	1,039,640.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	50.95	583,683.20
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	17.54	843,674.00

METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.19	1,055,571.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	27.61	999,482.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	69,984	27.86	1,949,754.24
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	104.88	1,224,474.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	7.73	1,261,536.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	15.52	650,288.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	60.50	1,717,776.50
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	17,900	10.37	185,623.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	131.65	1,316,500.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	30.16	1,227,512.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	505.99	1,295,334.40
TBEA CO LTD-A	22,519	25.46	573,333.74
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	11.42	493,344.00
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	5,320	151.18	804,277.60
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	5.18	1,032,892.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	13.14	264,258.54
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	34.44	1,088,304.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	38.82	320,653.20
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	11.39	1,027,378.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	5.84	467,784.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	5.52	444,912.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	42.13	463,430.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	10.26	265,734.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	338,800	4.56	1,544,928.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.78	191,200.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	6.36	1,020,780.00
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	49.37	1,002,211.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	57.77	307,278.63
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.41	240,204.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	20.30	1,130,710.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	17.97	392,464.80
BYD CO LTD -A	9,700	315.73	3,062,581.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	15.18	658,083.36
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	38.12	705,220.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	19.33	663,019.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	159.86	1,342,824.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	16.50	483,450.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	83.80	58,660.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	15.88	676,488.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	23.70	930,319.80
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	1,443	318.00	458,874.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	83.80	234,640.00



GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	30.15	1,311,525.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	25.10	696,776.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	45.91	364,158.12
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	124.33	957,341.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	24.33	632,580.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	4.31	439,620.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	44.76	358,080.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	60.00	1,572,000.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	5.38	426,634.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	12.72	425,865.60
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	20.02	490,490.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	9.38	502,768.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.94	828,036.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	278.79	808,491.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	28.05	457,215.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	15.48	352,944.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	4.51	277,365.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	192.41	2,347,402.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	8.05	889,525.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	18,576	31.15	578,642.40
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	52.12	528,496.80
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	48.45	518,415.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	246.60	394,560.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	50.65	111,430.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	56.64	1,036,512.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	156.45	469,350.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	8.78	522,410.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	24.00	247,200.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	46.96	469,600.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	111.00	876,900.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	30.24	139,104.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	20,248	79.16	1,602,831.68
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	22.44	614,856.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	62.90	1,069,300.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	26.80	32,160.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	36.19	1,241,389.38
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	45.90	794,070.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	174.43	1,587,313.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	5.83	161,491.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	148.99	834,344.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	36.75	422,625.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	46.42	324,940.00

KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	8,500	1,898.00	16,133,000.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	223.27	2,188,046.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	59.00	1,979,922.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	15.60	418,080.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	286.93	2,691,403.40
TONGWEI CO LTD-A	31,600	56.43	1,783,188.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	25.19	961,250.40
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	30,200	170.10	5,137,020.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	45.50	459,550.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	16.28	86,284.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	18.35	544,995.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	70,574	29.20	2,060,760.80
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	66.62	189,067.56
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	41.36	402,019.20
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	9,450	21.71	205,159.50
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	44.82	553,527.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	11.94	124,176.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	17.30	256,040.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	4.67	116,002.80
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	43.12	310,852.08
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	295.07	2,478,588.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	117.34	234,680.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	7.33	277,293.90
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	171.20	47,936.00
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	28,080	22.68	636,854.40
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	7,491	129.45	969,709.95
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	45.39	730,779.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	59.92	329,560.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	177.58	390,676.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	41.00	418,200.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	91.82	909,018.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	34.40	763,439.20
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	27.24	435,840.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	104.91	839,280.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	19.84	373,984.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	555.70	1,155,856.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	34.77	1,324,806.54
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	11,116	80.00	889,280.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	17.64	488,310.48
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	5.77	369,857.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	33.28	362,086.40
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	24.99	174,930.00

SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	9,440	21.51	203,054.40
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	21.60	242,611.20
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	41.92	712,640.00
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	89.55	1,474,351.20
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	53.46	531,392.40
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	294.00	1,146,600.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	20.02	180,580.40
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	23.92	833,564.16
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	45.85	444,745.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	2.82	997,152.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.11	238,380.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.58	452,962.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	14.30	1,611,610.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.08	1,626,559.20
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	10.54	1,554,650.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	28.77	1,677,291.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	5.83	265,265.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	5.47	683,203.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	2.83	364,787.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	137,700	33.70	4,640,490.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.62	990,432.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	3.24	999,864.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.11	610,134.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.35	1,136,220.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	17.88	1,702,176.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	12.61	1,505,634.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.43	626,845.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	7.22	998,526.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.28	401,800.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	12.62	1,002,028.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.50	429,975.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.59	111,241.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	9.21	430,107.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.11	375,732.60
CITIC SECURITIES CO-A	49,680	19.40	963,792.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	25.88	623,708.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	97,856	22.39	2,190,995.84
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	15.61	56,196.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	6.30	379,260.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	7.01	580,428.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	16.20	981,720.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	171,679	6.51	1,117,630.29

GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.72	1,064,256.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.85	1,193,592.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	83.20	449,280.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	13.13	413,595.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.30	719,901.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	8.48	362,096.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	8.73	354,228.48
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.17	864,024.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.87	441,180.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.97	479,389.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	20.29	369,278.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	43.12	2,880,416.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	14.61	799,167.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	15.83	850,071.00
GEMDALE CORP-A	45,500	11.46	521,430.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	566,400	2.47	1,399,008.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	16.68	1,364,424.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	20.14	257,792.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	11.64	98,940.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	7.30	196,370.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	162.20	782,290.60
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	26,460	12.45	329,427.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	9.35	269,280.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	5.86	326,402.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	32.44	537,271.28
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	37.21	401,868.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	13.65	453,180.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	91.71	275,130.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	7,943	37.52	298,021.36
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	126.67	696,685.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	20.00	263,400.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	30.89	1,170,731.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.79	434,334.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	28.83	807,240.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	9.23	321,204.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	117.23	1,066,793.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	13.93	289,744.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	9.36	422,136.00
GOERTEK INC -A	26,900	34.08	916,752.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	5.52	276,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	67.00	469,000.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	23.18	456,924.16

LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	11.13	186,984.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	46,450	38.70	1,797,615.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	92.96	160,634.88
NINESTAR CORP-A	18,543	50.65	939,202.95
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	5.90	184,670.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	16.10	391,230.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	86.55	411,978.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	71.36	459,201.60
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	27.33	778,905.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.65	453,550.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	17.49	320,766.60
WESTONE INFORMATION INDUST-A	20,100	34.20	687,420.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	62.51	262,542.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	41,316	13.66	564,376.56
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	186.20	875,140.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	70.88	797,400.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	14.71	445,713.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	30.13	262,131.00
ZTE CORP-A	12,600	24.53	309,078.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	6.56	1,140,128.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	6.28	1,515,364.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	23.39	4,207,393.20
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	21.46	1,193,176.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	4.48	1,414,336.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	11.07	748,332.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	13.50	1,246,050.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	125.72	892,234.84
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	85.36	865,379.68
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	3.92	323,400.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	114.90	720,652.80
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	15,120	66.65	1,007,748.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	41.03	307,725.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	82.33	617,475.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	24,430	64.38	1,572,803.40
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	24.94	743,212.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	47,040	53.06	2,495,942.40
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	53.39	1,124,126.45
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	282.54	875,874.00
SG MICRO CORP-A	3,150	160.80	506,520.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	388.00	1,086,400.00
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	29,500	51.05	1,505,975.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	9.53	312,107.50

	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	18.72	420,563.52
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	70.55	1,793,239.90
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	157.55	1,080,635.45
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	92.10	671,409.00
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	60.91	864,922.00
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	76.91	1,309,162.02
	オフショア人民元 小計	16,856,344		287,262,826.80 (5,748,531,332)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	17.86	802,610.54
	SAUDI ARABIAN OIL CO	288,739	38.70	11,174,199.30
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	52.90	622,897.50
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	16.78	535,751.84
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	28,237	178.00	5,026,186.00
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	50.20	1,620,606.60
	SAUDI ARABIAN MINING CO	95,014	78.00	7,411,092.00
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	106,249	103.20	10,964,896.80
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,414	26.95	1,035,257.30
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	15.46	1,599,043.26
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	52.00	1,380,912.00
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	215.00	904,505.00
	JARIR MARKETING CO	12,500	180.00	2,250,000.00
	ALMARAI CO	30,130	52.80	1,590,864.00
	SAVOLA	25,336	32.65	827,220.40
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	211.20	2,474,630.40
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	238.20	1,896,548.40
	AL RAJHI BANK	237,965	90.70	21,583,425.50
	ALINMA BANK	109,956	37.95	4,172,830.20
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	32.00	2,752,992.00
	BANK AL-JAZIRA	35,813	23.92	856,646.96
	BANK ALBILAD	61,145	54.00	3,301,830.00
	BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	52.00	3,511,872.00
	RIYAD BANK	166,012	36.90	6,125,842.80
	SAUDI BRITISH BANK	116,762	41.50	4,845,623.00
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	41,945	20.10	843,094.50
	THE SAUDI NATIONAL BANK	265,761	70.50	18,736,150.50
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	3,929	221.00	868,309.00
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	173.00	1,048,899.00
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	14.10	1,423,973.10
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	10.60	489,582.20	
ELM CO	2,436	328.40	799,982.40	
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	38.80	1,335,263.20	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	11.92	1,078,855.36	

	SAUDI TELECOM CO	66,310	105.80	7,015,598.00	
	ACWA POWER CO	9,184	174.40	1,601,689.60	
	SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	26.05	2,402,357.05	
	サウジアラビアリアル 小計	2,540,586		136,912,037.71 (5,049,315,950)	
	合 計	1,069,908,239		108,655,620,952 (108,655,620,952)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	7,269,048.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	7,269,048.00 (50,103,367)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	3,333,525.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,380,213.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,589,126.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,270,682.00	
ブラジルリアル 小計	279,400	7,573,546.00 (206,836,570)			
投資信託受益証券合計			337,800	256,939,937 (256,939,937)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	8,037,684.00	
		メキシコペソ 小計	391,700	8,037,684.00 (55,401,344)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	6,309,700.94	
		南アフリカランド 小計	478,733	6,309,700.94 (51,424,062)	
投資証券合計			870,433	106,825,406 (106,825,406)	
合計				363,765,343 (363,765,343)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 41銘柄	100.0%			3.1%
メキシコペソ	株式 20銘柄	95.4%			2.0%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.2%		0.0%
	投資証券 1銘柄			2.4%	0.1%
ブラジルレアル	株式 44銘柄	96.5%			5.3%
	投資信託受 益証券 4銘柄		3.5%		0.2%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%			0.6%
コロンビアペソ	株式 4銘柄	100.0%			0.2%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 12銘柄	100.0%			0.3%
チェココルナ	株式 2銘柄	100.0%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.0%			0.5%
ロシアルーブル	株式 13銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式 197銘柄	100.0%			23.9%
マレーシアリンギット	株式 34銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式 42銘柄	100.0%			1.9%
フィリピンペソ	株式 20銘柄	100.0%			0.8%
インドネシアルピア	株式 25銘柄	100.0%			1.9%
韓国ウォン	株式 112銘柄	100.0%			11.4%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%			14.7%
インドルピー	株式 109銘柄	100.0%			14.2%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.0%			1.1%
南アフリカランド	株式 36銘柄	98.7%			3.5%
	投資証券 1銘柄			1.3%	0.0%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 9銘柄	100.0%			1.3%
クウェートディナール	株式 7銘柄	100.0%			0.9%
オフショア人民元	株式 323銘柄	100.0%			5.3%
サウジアラビアリアル	株式 37銘柄	100.0%			4.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表



注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 8月29日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,823,159,525
国債証券	524,693,821,400
地方債証券	33,312,708,349
特殊債券	37,732,989,893
社債券	29,560,383,520
未収入金	499,510,000
未収利息	1,437,429,910
前払金	1,200,000
前払費用	28,233,956
流動資産合計	629,089,436,553
資産合計	629,089,436,553
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,200,990
未払金	2,891,245,200
未払解約金	141,466,409
未払利息	3,050
流動負債合計	3,033,915,649
負債合計	3,033,915,649
純資産の部	
元本等	
元本	455,969,657,054
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	170,085,863,850
元本等合計	626,055,520,904
純資産合計	626,055,520,904
負債純資産合計	629,089,436,553

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 8月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2022年 8月29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。
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 8月29日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	455,969,657,054口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。  有価証券 100,165,000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 1.3730円 (1万口当たり純資産額) (13,730円)

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

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2022年 8月29日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

	2022年 8月29日現在

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2022年 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	468,883,493,377円
期中追加設定元本額	42,307,617,453円
期中一部解約元本額	55,221,453,776円
期末元本額	455,969,657,054円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,131,571,272円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,934,587円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,830,510,857円
世界経済インデックスファンド	3,993,130,449円
D C マイセレクション 2 5	25,875,161,952円
D C マイセレクション 5 0	29,658,401,062円
D C マイセレクション 7 5	8,685,041,351円
D C 日本債券インデックス・オープン	439,924,073円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,471,403,120円
D C 日本債券インデックス・オープン P	66,873,377,000円
D C マイセレクション S 2 5	13,158,772,949円
D C マイセレクション S 5 0	14,676,913,531円
D C マイセレクション S 7 5	3,349,452,415円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	686,481,171円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,325,049,048円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	879,818,547円
D C 世界経済インデックスファンド	3,465,772,379円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,791,837円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	31,497,651円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	9,937,325円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	972,063円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	83,799,954円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	123,867,935円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	34,194,591円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	27,614,470円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,780,258,408円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	749,828,496円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,129,469,850円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	76,678,284円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	54,711,961円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	971,350,867円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,111,169,719円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,414,486,224円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	137,606,889円

区分	2022年 8月29日現在
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,571,025,390円
日本債券ファンド・シリーズ1	16,481,614,128円
分散投資コア戦略ファンドA	20,452,828,218円
分散投資コア戦略ファンドS	25,702,211,927円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	168,870,277円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,419,861,537円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	72,696,859円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	36,691,535円
SMT インデックスバランス・オープン	61,720,142円
SMT 世界経済インデックス・オープン	39,537,438円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	78,179,441円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	123,183,752円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,470,978円
グローバル経済コア	235,153,640円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	31,853,077円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	20,312,114円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	33,482,313円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	17,839,373円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	4,477,976円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,762,691円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	8,738,856円
10資産分散投資ファンド	89,612円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	82,722,395,970円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	89,400,662円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,694,845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）	309,384,776円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 8月29日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,263,596,250
地方債証券	241,646,231
特殊債券	226,937,060
社債券	269,450,860
合計	6,001,630,401

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2022年 8月29日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	448,860,000	-	447,660,000	1,200,000
	合計	448,860,000	-	447,660,000	1,200,000

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第428回利付国債(2年)	230,000,000	230,322,000	
	第429回利付国債(2年)	950,000,000	951,396,500	
	第430回利付国債(2年)	990,000,000	991,504,800	
	第432回利付国債(2年)	1,550,000,000	1,552,495,500	
	第433回利付国債(2年)	1,910,000,000	1,913,132,400	
	第434回利付国債(2年)	1,915,000,000	1,918,159,750	
	第435回利付国債(2年)	3,120,000,000	3,125,428,800	
	第436回利付国債(2年)	720,000,000	721,260,000	
	第438回利付国債(2年)	290,000,000	290,504,600	
	第439回利付国債(2年)	470,000,000	470,813,100	
	第137回利付国債(5年)	6,610,000,000	6,626,392,800	
	第138回利付国債(5年)	6,890,000,000	6,908,878,600	
	第139回利付国債(5年)	5,590,000,000	5,607,384,900	
	第140回利付国債(5年)	4,660,000,000	4,675,983,800	
	第141回利付国債(5年)	7,650,000,000	7,679,146,500	
	第142回利付国債(5年)	4,370,000,000	4,388,659,900	
	第143回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,822,080,000	
	第144回利付国債(5年)	5,830,000,000	5,859,499,800	

第145回利付国債(5年)	5,670,000,000	5,700,391,200	
第146回利付国債(5年)	4,120,000,000	4,143,195,600	
第147回利付国債(5年)	4,170,000,000	4,180,383,300	
第148回利付国債(5年)	6,770,000,000	6,785,435,600	
第149回利付国債(5年)	4,820,000,000	4,828,772,400	
第150回利付国債(5年)	7,700,000,000	7,708,239,000	
第151回利付国債(5年)	4,000,000,000	4,000,880,000	
第152回利付国債(5年)	210,000,000	210,907,200	
第153回利付国債(5年)	410,000,000	409,606,400	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	516,072,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,404,194,500	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	686,636,500	
第4回利付国債(40年)	950,000,000	1,186,084,500	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,284,770,400	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,478,660,400	
第7回利付国債(40年)	1,240,000,000	1,396,277,200	
第8回利付国債(40年)	1,230,000,000	1,289,089,200	
第9回利付国債(40年)	2,050,000,000	1,589,242,000	
第10回利付国債(40年)	2,100,000,000	1,908,816,000	
第11回利付国債(40年)	1,635,000,000	1,436,216,700	
第12回利付国債(40年)	1,290,000,000	1,017,887,400	
第13回利付国債(40年)	2,120,000,000	1,666,786,400	
第14回利付国債(40年)	2,130,000,000	1,792,565,400	
第15回利付国債(40年)	610,000,000	559,998,300	
第330回利付国債(10年)	3,910,000,000	3,948,709,000	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	907,002,000	
第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,844,592,000	
第333回利付国債(10年)	3,320,000,000	3,356,154,800	
第334回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,313,122,200	
第335回利付国債(10年)	2,310,000,000	2,337,835,500	
第336回利付国債(10年)	1,210,000,000	1,226,359,200	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,824,892,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,615,996,800	
第339回利付国債(10年)	4,670,000,000	4,732,998,300	
第340回利付国債(10年)	4,830,000,000	4,900,276,500	
第341回利付国債(10年)	5,340,000,000	5,405,468,400	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,787,941,200	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,685,779,700	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,933,512,000	
第345回利付国債(10年)	3,780,000,000	3,799,542,600	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,776,162,500	
第347回利付国債(10年)	3,850,000,000	3,864,784,000	

第348回利付国債(10年)	4,540,000,000	4,553,710,800	
第349回利付国債(10年)	5,000,000,000	5,011,900,000	
第350回利付国債(10年)	6,390,000,000	6,400,543,500	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,940,000,000	4,944,248,400	
第352回利付国債(10年)	4,510,000,000	4,511,353,000	
第353回利付国債(10年)	5,415,000,000	5,411,588,550	
第354回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,782,192,300	
第355回利付国債(10年)	3,820,000,000	3,808,387,200	
第356回利付国債(10年)	3,380,000,000	3,363,471,800	
第357回利付国債(10年)	2,770,000,000	2,751,025,500	
第358回利付国債(10年)	3,560,000,000	3,532,160,800	
第359回利付国債(10年)	3,360,000,000	3,330,331,200	
第360回利付国債(10年)	4,890,000,000	4,841,589,000	
第361回利付国債(10年)	4,180,000,000	4,135,692,000	
第362回利付国債(10年)	3,790,000,000	3,747,097,200	
第363回利付国債(10年)	5,070,000,000	5,008,754,400	
第364回利付国債(10年)	3,710,000,000	3,667,186,600	
第365回利付国債(10年)	6,740,000,000	6,663,164,000	
第366回利付国債(10年)	5,970,000,000	5,981,163,900	
第367回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,434,470,400	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	130,265,300	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	186,067,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	139,159,200	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	133,922,800	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	58,470,500	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	419,363,000	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	215,836,200	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	403,711,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	267,194,400	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	173,270,400	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	298,095,200	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	226,360,300	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	472,812,000	
第14回利付国債(30年)	800,000,000	983,744,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	422,633,600	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	249,026,000	
第17回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,421,434,500	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	422,845,800	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	650,686,300	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	602,097,600	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	615,745,000	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	680,540,400	



第23回利付国債(30年)	430,000,000	542,810,500
第24回利付国債(30年)	780,000,000	985,537,800
第25回利付国債(30年)	600,000,000	742,710,000
第26回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,741,197,400
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,437,228,800
第28回利付国債(30年)	2,090,000,000	2,660,570,000
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,104,099,800
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,206,464,300
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,354,518,000
第32回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,697,511,200
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,183,526,800
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,215,299,250
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	2,765,543,000
第36回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,564,328,300
第37回利付国債(30年)	2,255,000,000	2,674,475,100
第38回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,645,794,300
第39回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,754,717,600
第40回利付国債(30年)	1,380,000,000	1,609,839,000
第41回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,319,188,000
第42回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,329,916,800
第43回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,489,566,000
第44回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,454,302,400
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,590,163,200
第46回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,776,119,800
第47回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,830,310,700
第48回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,848,544,200
第49回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,727,488,000
第50回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,630,809,900
第51回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,446,454,800
第52回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,424,866,100
第53回利付国債(30年)	1,320,000,000	1,193,412,000
第54回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,623,370,400
第55回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,355,803,200
第56回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,390,045,600
第57回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,321,029,000
第58回利付国債(30年)	2,350,000,000	2,196,216,000
第59回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,282,451,400
第60回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,551,401,400
第61回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,319,299,800
第62回利付国債(30年)	480,000,000	410,270,400
第63回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,350,455,000
第64回利付国債(30年)	1,790,000,000	1,477,877,700
第65回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,159,504,350

第66回利付国債(30年)	1,010,000,000	834,047,900	
第67回利付国債(30年)	1,865,000,000	1,616,526,050	
第68回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,288,820,200	
第69回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,190,871,400	
第70回利付国債(30年)	1,780,000,000	1,575,638,200	
第71回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,263,419,300	
第72回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,014,093,000	
第73回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,649,377,400	
第74回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,656,845,400	
第75回利付国債(30年)	550,000,000	562,688,500	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	326,896,000	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	225,786,000	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	338,246,700	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	134,044,300	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	196,798,200	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	403,345,800	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	418,008,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	208,282,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	658,299,600	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	377,348,400	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	210,100,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	137,250,100	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	283,678,200	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	305,430,900	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	179,463,900	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	285,789,600	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	233,483,800	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	414,796,200	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	639,990,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	310,856,800	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	502,246,700	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	312,303,900	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	552,855,300	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,977,260,100	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	457,716,000	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	380,096,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	687,210,300	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	492,691,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	960,414,400	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	447,334,600	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	668,328,200	
第95回利付国債(20年)	610,000,000	676,764,500	

第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,748,761,500
第97回利付国債(20年)	900,000,000	998,118,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	485,746,800
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,429,578,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	536,553,600
第101回利付国債(20年)	715,000,000	807,156,350
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,428,915,600
第103回利付国債(20年)	400,000,000	451,312,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	178,675,200
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,322,886,200
第106回利付国債(20年)	380,000,000	428,305,600
第107回利付国債(20年)	760,000,000	854,992,400
第108回利付国債(20年)	870,000,000	967,840,200
第109回利付国債(20年)	520,000,000	580,184,800
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,241,614,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,105,072,500
第112回利付国債(20年)	790,000,000	894,682,900
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,293,467,600
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,651,656,500
第115回利付国債(20年)	700,000,000	801,682,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,712,367,600
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,233,144,000
第118回利付国債(20年)	660,000,000	751,014,000
第119回利付国債(20年)	530,000,000	594,940,900
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,738,256,900
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,700,175,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,057,998,200
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,157,662,100
第124回利付国債(20年)	610,000,000	698,858,700
第125回利付国債(20年)	1,770,000,000	2,064,209,400
第126回利付国債(20年)	730,000,000	839,083,900
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,163,860,800
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,110,281,400
第129回利付国債(20年)	740,000,000	840,632,600
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,465,940,850
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,131,930,000
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,317,771,600
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,408,522,200
第134回利付国債(20年)	830,000,000	952,698,900
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,172,634,400
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,637,224,000
第137回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,209,417,600
第138回利付国債(20年)	620,000,000	695,503,600

第139回利付国債(20年)	830,000,000	939,037,100	
第140回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,764,245,000	
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,830,352,000	
第142回利付国債(20年)	980,000,000	1,130,920,000	
第143回利付国債(20年)	1,920,000,000	2,178,662,400	
第144回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,293,152,000	
第145回利付国債(20年)	2,675,000,000	3,066,941,000	
第146回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,099,573,000	
第147回利付国債(20年)	2,250,000,000	2,560,072,500	
第148回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,311,785,000	
第149回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,045,087,000	
第150回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,824,264,300	
第151回利付国債(20年)	2,445,000,000	2,671,284,750	
第152回利付国債(20年)	2,840,000,000	3,100,456,400	
第153回利付国債(20年)	2,630,000,000	2,902,415,400	
第154回利付国債(20年)	2,655,000,000	2,895,197,850	
第155回利付国債(20年)	2,800,000,000	2,980,236,000	
第156回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,443,866,400	
第157回利付国債(20年)	2,950,000,000	2,821,114,500	
第158回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,592,956,700	
第159回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,491,482,400	
第160回利付国債(20年)	1,890,000,000	1,920,429,000	
第161回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,990,000,000	
第162回利付国債(20年)	630,000,000	628,261,200	
第163回利付国債(20年)	1,980,000,000	1,968,951,600	
第164回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,290,207,600	
第165回利付国債(20年)	2,150,000,000	2,096,250,000	
第166回利付国債(20年)	1,820,000,000	1,823,931,200	
第167回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,142,153,000	
第168回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,577,929,600	
第169回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,853,585,500	
第170回利付国債(20年)	2,240,000,000	2,078,115,200	
第171回利付国債(20年)	1,670,000,000	1,544,232,300	
第172回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,259,881,100	
第173回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,196,639,000	
第174回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,310,715,200	
第175回利付国債(20年)	2,030,000,000	1,918,959,000	
第176回利付国債(20年)	2,850,000,000	2,685,811,500	
第177回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,160,498,600	
第178回利付国債(20年)	1,960,000,000	1,839,930,400	
第179回利付国債(20年)	2,935,000,000	2,748,656,850	
第180回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,381,803,000	

	第181回利付国債(20年)	800,000,000	803,376,000
	国債証券合計	510,230,000,000	524,693,821,400
地方債証券	第2回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	100,000,000	100,085,000
	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,489,000
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	87,077,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,027,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	123,911,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	121,453,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	117,384,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	115,102,000
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	222,088,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,542,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,493,000
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	87,366,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	225,940,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	225,682,000
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,800,000
	第726回東京都公募公債	200,000,000	201,874,000
	第728回東京都公募公債	100,000,000	100,832,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	101,089,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,503,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,286,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	299,307,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	196,632,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,593,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,111,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,612,000
	平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	199,492,000
	第29回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	100,769,000
	第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	254,530,000
	第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,224,000
	第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	225,580,000
	第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	113,998,000
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,648,000
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,208,000
	第78回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	199,944,000
	第201回神奈川県公募公債	200,250,000	201,711,825
	第210回神奈川県公募公債	200,000,000	201,964,000
	第215回神奈川県公募公債	100,000,000	101,302,000
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,511,000
	第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,435,000

第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,286,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	196,560,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	225,698,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	226,276,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	112,724,000	
第377回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,835,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,083,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	152,606,640	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,464,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,452,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	156,201,240	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,462,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,468,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	99,765,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	156,838,400	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	178,361,820	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	195,948,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	113,160,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	112,848,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	100,830,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,466,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	95,861,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	98,911,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	137,895,130	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	111,136,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	101,393,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	106,680,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,516,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,479,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	455,056,000	
平成25年度第7回兵庫県公募公債	100,000,000	100,801,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,072,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	97,443,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	296,337,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	109,079,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	91,876,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	112,664,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,015,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,148,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,334,000	

平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,429,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,326,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	306,354,400	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	113,497,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,085,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	202,234,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,141,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,041,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,858,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	295,077,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,987,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	90,594,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	196,680,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,529,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	173,356,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	112,759,000	
平成21年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	225,912,000	
平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	100,817,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,996,995	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,283,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	385,444,800	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	111,013,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	112,280,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	96,003,000	
第7回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	227,148,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	200,000,000	193,510,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	225,580,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	192,244,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,008,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,423,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,057,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,675,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,310,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	98,295,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	98,146,000	

令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	146,995,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,053,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,293,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	105,259,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	114,072,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	105,971,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	120,843,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,965,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,420,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,407,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	90,594,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	98,069,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	295,983,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	98,263,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	95,593,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	224,560,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	113,138,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	112,664,000	
平成25年度第8回千葉県公募公債	300,000,000	302,436,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	100,907,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,993,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	101,416,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,057,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,465,600	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	294,795,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,502,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	295,863,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	200,000,000	198,852,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	223,798,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,230,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,769,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,799,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,100,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,961,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,042,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,270,080	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,163,000	



第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,121,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,075,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,126,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,994,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,854,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,284,762	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,476,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,178,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,110,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,082,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,884,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,912,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,871,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,388,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,657,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,572,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,200,907	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,281,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,880,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,163,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,152,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,285,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	99,451,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	226,700,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	86,387,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	289,077,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	99,530,000	
平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,073,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	196,702,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	123,788,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	125,775,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	111,417,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	113,887,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,550,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	295,875,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,776,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	131,330,400	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	224,900,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	113,938,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	113,138,000	

令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	86,235,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	86,574,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	106,005,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	337,905,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,366,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,526,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	100,046,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,438,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	219,916,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	295,887,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	98,350,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	106,219,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,933,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	111,891,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,343,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	98,150,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,975,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,448,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,091,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	112,803,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	111,448,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	202,222,000	
平成30年度第10回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	100,007,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	151,464,000	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,999,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,360,150	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,460,700	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	541,871,000	
令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	199,872,000	
令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	196,530,000	
令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	296,205,000	
令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	99,193,000	
平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,134,000	
平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	201,450,000	
平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	99,385,000	
第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	110,887,000	
地方債証券合計	32,411,680,000	33,312,708,349	

特殊債券	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,128,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,013,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,439,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	77,771,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,924,000	
	第21回道路債券	100,000,000	123,845,000	
	第27回道路債券	400,000,000	414,844,000	
	第28回道路債券	200,000,000	250,712,000	
	第33回道路債券	200,000,000	253,630,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,960,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,501,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,559,000	
	第42回道路債券	100,000,000	105,546,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,858,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	127,337,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	225,698,000	
	第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	227,496,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,940,000	
	第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,222,000	
	第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,755,000	
	第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,970,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,010,000	
	第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,605,000	
	第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,971,000	
	第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,223,000	
第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,883,000		
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,981,000		
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,594,000		
	200,000,000	215,424,000		

第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,288,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	588,102,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,784,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	148,000,000	149,309,800	
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,837,000	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	265,800,000	268,083,222	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,888,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,527,000	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	533,000,000	538,788,380	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,132,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	223,182,000	
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	103,164,840	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,205,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,178,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	221,420,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,180,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,095,000	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,361,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,892,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,088,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,086,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,454,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	85,271,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,771,020	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,434,600	
	100,000,000	100,300,000	

第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,516,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,179,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	120,294,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,782,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	294,627,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	214,477,220	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,488,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,137,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	362,268,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	105,769,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	375,609,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,397,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	250,784,000	
第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	41,390,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	123,403,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	226,004,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	221,662,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	600,000,000	600,144,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	169,276,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,531,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	226,542,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	112,453,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	562,490,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	105,875,700	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	706,944,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,019,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,119,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,210,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,071,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,081,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,764,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	211,834,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,229,000	

第 8 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,017,000	
第 8 3 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,184,000	
第 8 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,955,000	
第 9 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,128,000	
第 9 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,642,560	
F 9 5 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,147,000	
第 9 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,259,000	
第 9 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,207,000	
第 1 0 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,297,000	
F 1 0 7 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,425,000	
第 1 1 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	156,312,000	
第 1 1 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,227,000	
第 1 1 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,325,000	
第 1 1 9 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,976,000	
第 1 2 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,419,000	
F 1 3 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,030,000	
F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,816,000	
F 2 0 2 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,520,000	
F 2 0 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,636,000	
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,732,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,782,000	
F 4 4 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,239,000	
第 2 9 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,786,000	
第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	105,322,000	
第 1 9 回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,794,000	
第 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	112,955,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	114,931,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,021,420	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,259,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,628,300	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	187,377,740	
第 5 4 回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	220,050,600	
第 8 7 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,898,000	
第 8 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,942,000	
第 8 9 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,949,000	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	206,612,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	145,722,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	80,234,000	
第 1 7 1 回都市再生債券	200,000,000	171,770,000	

第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,943,000	
第16回政府保証民間都市開発債券	180,000,000	181,467,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,553,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	9,939,000	9,959,374	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,337,000	10,426,311	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,439,000	10,547,983	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	128,475,000	127,453,623	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,699,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	89,544,000	88,775,712	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	109,878,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,370,000	10,469,240	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,298,000	11,480,010	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	159,501,000	157,811,884	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,114,000	11,287,044	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	182,121,000	179,853,593	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	64,936,000	64,253,522	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,579,000	11,823,085	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	219,006,000	215,902,684	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	9,913,000	9,932,330	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	151,398,000	149,376,836	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,714,000	11,981,313	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,043,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,529,000	16,263,987	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,629,000	16,406,230	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,492,000	18,497,615	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,237,000	20,255,406	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,141,000	22,383,667	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,658,000	22,891,206	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,990,000	47,429,807	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,160,000	10,262,616	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,438,000	21,468,279	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,369,000	10,453,922	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,952,000	9,974,192	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,735,000	21,769,883	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,369,000	21,413,318	

第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,209,000	20,142,941	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,268,000	11,485,359	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,668,000	42,420,790	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,484,000	22,429,725	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,903,000	11,074,177	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,496,000	29,731,871	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,228,000	28,384,917	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,400,000	28,588,886	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,100,000	62,557,489	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,814,000	76,397,490	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,027,000	39,317,636	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,802,000	40,444,488	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,041,000	40,739,283	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,219,000	35,592,550	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,467,000	34,560,701	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,974,000	40,709,512	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	171,546,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	102,018,000	105,343,786	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,056,000	142,534,536	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,564,000	40,771,097	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,896,000	42,166,229	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,792,000	42,968,026	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,350,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,111,000	135,765,190	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,499,000	46,570,046	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,332,000	96,904,024	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,199,000	54,227,336	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,971,000	57,882,536	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	319,824,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,425,000	57,605,975	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,951,000	179,237,299	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,952,000	120,671,973	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,224,000	58,431,426	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,899,000	63,192,070	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,172,000	67,438,469	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,856,000	73,220,099	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,534,000	72,722,184	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,859,000	73,350,850	
	74,394,000	74,187,928	



第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,763,000	74,423,575	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,601,000	76,174,332	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,053,000	76,693,933	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,040,000	76,464,511	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,942,000	76,364,165	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,707,000	77,144,401	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,366,000	155,858,433	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,843,000	77,228,818	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,022,000	158,077,409	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,964,000	78,322,812	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,302,000	156,714,230	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,096,000	79,416,785	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,226,000	159,554,086	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,304,000	160,578,708	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,457,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,890,000	81,416,675	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,590,000	81,291,380	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,782,000	80,805,522	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,784,000	165,995,688	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,555,000	83,054,994	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,834,000	82,470,020	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,890,000	166,837,076	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,340,000	84,176,319	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	260,622,000	252,725,153	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,762,000	169,416,030	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,009,000	87,480,715	

第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,603,000	87,813,628
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,272,000	181,935,431
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,146,000	91,808,423
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,338,000	183,593,241
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,928,000	184,797,119
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,458,000	92,143,045
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,952,000	186,033,010
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,310,000	187,127,255
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,118,000	93,918,562
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,624,000	94,722,439
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	289,524,000	283,776,948
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,910,000	95,096,813
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,399,000	97,781,054
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,179,000	98,673,187
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,925,000
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,982,000
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	93,413,000
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	86,433,000
第64回日本学生支援債券	300,000,000	299,922,000
第65回日本学生支援債券	200,000,000	199,942,000
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	105,581,000
第24回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	600,540,000
い第823号商工債	200,000,000	200,268,000
い第829号商工債	200,000,000	200,144,000
い第832号商工債	200,000,000	199,812,000
い第833号商工債	100,000,000	99,881,000
い第843号商工債	200,000,000	199,940,000
い第847号商工債	100,000,000	99,834,000
い第850号商工債	200,000,000	199,572,000
第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,022,000
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,660,000
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,750,000
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,660,000

	第385回信金中金債（5年）	100,000,000	99,483,000	
	第254号商工債（3年）	300,000,000	299,862,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,257,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	113,407,000	
	第53回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,054,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,405,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	197,784,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	493,280,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,401,000	
	第60回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,895,000	
	第63回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,876,000	
	第66回西日本高速道路株式会社社債	800,000,000	800,136,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,699,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,899,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	194,474,000	
	特殊債券合計	36,836,035,000	37,732,989,893	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,799,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	298,551,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,633,000	
	第8回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,103,000	
	第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,892,000	
	第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,909,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,607,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,424,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,759,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,742,000	
	第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	199,758,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,098,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	299,217,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,009,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,095,000	
	第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,722,000	
	第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,140,000	

第13回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,774,000	
第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,973,000	
第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,438,000	
第8回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,514,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,983,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,742,000	
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	99,077,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,492,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,045,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	100,098,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,667,000	
第13回JSR株式会社無担保社債	100,000,000	99,633,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,781,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	198,868,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	200,060,000	
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,442,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	92,685,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,533,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,708,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,072,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	199,158,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	291,069,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,110,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,471,000	
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,477,000	
第19回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	93,667,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,734,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,620,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,735,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,168,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,939,000	

第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,094,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,686,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	99,645,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,038,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,303,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,855,000	
第14回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	99,856,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,815,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	106,093,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,789,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,632,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,072,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	98,901,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,200,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,394,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,924,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,827,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,204,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,754,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,766,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,019,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,833,000	
第11回J.A.三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,999,000	
第22回J.A.三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,856,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,700,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	196,684,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,906,000	
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,934,000	
第8回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	94,785,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,620,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	91,710,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,107,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,718,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	113,037,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	197,144,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,570,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,577,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,822,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	98,383,000	

第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	99,855,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	114,517,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	109,368,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,870,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,795,000	
第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	302,304,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,535,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,557,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,590,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	197,892,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,909,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,925,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,852,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,921,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,828,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,031,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,983,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,362,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,096,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,318,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,999,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,778,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,181,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,035,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,440,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,630,000	
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,018,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,980,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	198,960,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,630,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,357,000	

第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,563,000	
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	800,000,000	800,032,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,344,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	199,278,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,572,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,726,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	93,494,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	97,913,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,229,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,296,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	97,543,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,685,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,818,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	98,824,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,444,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	93,413,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,734,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,146,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	93,124,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,604,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	94,052,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,286,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,737,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	223,986,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,129,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,774,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	91,988,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,118,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	87,650,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	92,055,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	83,567,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,096,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	87,299,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,771,000	

第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	498,775,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	91,831,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	122,150,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,842,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,882,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	91,548,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	78,865,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	73,107,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	85,467,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	92,810,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	169,670,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,536,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,876,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,591,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	396,756,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	183,726,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	94,878,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	93,931,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,671,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,175,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,407,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	90,622,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,503,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,074,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,091,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,741,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,625,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,159,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,147,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,465,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,986,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,324,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,859,000	
第442回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,970,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,411,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,339,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,130,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	127,577,520	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,011,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,305,000	



第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,810,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,871,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,437,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,147,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,636,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,140,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,433,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,700,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,166,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,226,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,565,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,176,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,797,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	95,518,000	
第377回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,970,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	96,265,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,313,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,315,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,384,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	198,476,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,535,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,447,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	298,545,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,707,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,900,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,954,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	280,080,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	98,119,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	87,134,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	195,358,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	194,560,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	92,055,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	199,760,000	
社債券合計	29,926,000,000	29,560,383,520	
合計		625,299,903,162	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 貸借対照表

	2022年 8月29日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	115,487,731
コール・ローン	1,346,796,764
国債証券	66,475,337,656
派生商品評価勘定	2,195,770
未収入金	161,474
未収利息	339,719,114
前払金	11,464,083
前払費用	33,559,463
差入委託証拠金	72,867,365
流動資産合計	68,397,589,420
資産合計	68,397,589,420
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,919,547,442
未払解約金	274,826
未払利息	2,253
流動負債合計	1,919,824,521
負債合計	1,919,824,521
純資産の部	
元本等	
元本	73,902,368,400
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,424,603,501
元本等合計	66,477,764,899
純資産合計	66,477,764,899
負債純資産合計	68,397,589,420

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 8月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	2022年 8月29日現在
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2022年 8月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	73,902,368,400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 7,424,603,501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 0.8995円 (1万口当たり純資産額) (8,995円)

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 8月29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 8月29日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2022年 8月29日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	30,739,437,808円
期中追加設定元本額	59,494,600,234円
期中一部解約元本額	16,331,669,642円
期末元本額	73,902,368,400円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	19,931,709,696円
分散投資コア戦略ファンドS	25,296,023,847円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	278,668,498円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	117,638,698円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	21,787,540円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	4,707,356円
10資産分散投資ファンド	136,344円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	6,209,949,338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）	2,684,617,150円
S M T A M 海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	3,196,089,566円
S M T A M 海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	3,245,304,131円
S M T A M 海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,228,758,285円

区分	2022年 8月29日現在
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	3,095,873,892円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	3,047,707,638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）	3,543,396,421円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 8月29日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	8,323,744,033	
合計	8,323,744,033	

(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（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）

## 債券関連

（2022年 8月29日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,174,198,433	-	1,162,734,350	11,464,083
	合計	1,174,198,433	-	1,162,734,350	11,464,083

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2022年 8月29日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	67,053,313,191	-	68,959,200,780	1,905,887,589
	アメリカドル	33,899,544,580	-	35,351,562,240	1,452,017,660
	カナダドル	1,438,012,936	-	1,470,510,030	32,497,094

	メキシコペソ	523,553,551	-	557,753,967	34,200,416
	ユーロ	23,298,644,378	-	23,577,415,226	278,770,848
	イギリスポンド	3,403,515,051	-	3,403,650,960	135,909
	スウェーデンクローナ	177,243,567	-	175,351,784	1,891,783
	ノルウェークローネ	137,154,509	-	141,371,094	4,216,585
	デンマーククローネ	255,213,900	-	258,580,000	3,366,100
	ポーランドズロチ	283,062,621	-	287,787,123	4,724,502
	オーストラリアドル	1,053,159,166	-	1,079,110,524	25,951,358
	シンガポールドル	282,905,113	-	291,436,332	8,531,219
	マレーシアリンギット	345,073,054	-	357,392,010	12,318,956
	イスラエルシェケル	270,643,222	-	291,142,465	20,499,243
	オフショア人民元	1,685,587,543	-	1,716,137,025	30,549,482
	合計	67,053,313,191	-	68,959,200,780	1,905,887,589

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	1,950,000.00	1,864,992.18	
		T 0.125% 02/15/24	2,100,000.00	2,003,326.16	
		T 0.125% 09/15/23	3,500,000.00	3,386,318.35	
		T 0.125% 10/15/23	3,640,000.00	3,511,035.92	
		T 0.125% 12/15/23	200,000.00	191,855.46	
		T 0.25% 03/15/24	1,950,000.00	1,858,746.10	
		T 0.25% 05/15/24	2,200,000.00	2,086,218.74	
		T 0.25% 05/31/25	1,000,000.00	917,734.38	

T 0.25% 06/15/24	1,900,000.00	1,797,169.92	
T 0.25% 06/30/25	1,940,000.00	1,776,085.14	
T 0.25% 07/31/25	600,000.00	547,710.93	
T 0.25% 08/31/25	400,000.00	364,250.00	
T 0.25% 09/30/23	3,300,000.00	3,192,685.55	
T 0.25% 09/30/25	1,250,000.00	1,136,035.16	
T 0.25% 10/31/25	1,940,000.00	1,758,276.57	
T 0.25% 11/15/23	1,000,000.00	963,574.22	
T 0.375% 01/31/26	1,550,000.00	1,400,509.76	
T 0.375% 04/15/24	800,000.00	762,093.75	
T 0.375% 04/30/25	1,550,000.00	1,431,085.93	
T 0.375% 07/15/24	1,000,000.00	945,820.31	
T 0.375% 07/31/27	1,000,000.00	871,718.75	
T 0.375% 08/15/24	1,200,000.00	1,132,031.25	
T 0.375% 09/15/24	1,000,000.00	940,937.50	
T 0.375% 09/30/27	1,020,000.00	883,933.59	
T 0.375% 10/31/23	3,120,000.00	3,014,821.86	
T 0.375% 11/30/25	800,000.00	726,218.75	
T 0.375% 12/31/25	1,700,000.00	1,539,496.09	
T 0.5% 02/28/26	3,650,000.00	3,305,816.42	
T 0.5% 03/31/25	1,270,000.00	1,179,512.50	
T 0.5% 04/30/27	1,900,000.00	1,674,746.08	
T 0.5% 05/31/27	1,350,000.00	1,187,736.33	
T 0.5% 06/30/27	1,920,000.00	1,685,774.99	
T 0.5% 08/31/27	300,000.00	262,464.84	
T 0.5% 10/31/27	700,000.00	609,546.87	
T 0.5% 11/30/23	4,000,000.00	3,859,921.88	
T 0.625% 03/31/27	260,000.00	231,085.15	
T 0.625% 05/15/30	1,620,000.00	1,350,675.00	
T 0.625% 07/31/26	1,000,000.00	900,976.56	
T 0.625% 08/15/30	2,020,000.00	1,675,653.12	
T 0.625% 10/15/24	3,500,000.00	3,303,671.87	
T 0.625% 11/30/27	1,670,000.00	1,460,597.66	
T 0.625% 12/31/27	1,370,000.00	1,195,753.12	
T 0.75% 01/31/28	1,270,000.00	1,114,276.16	
T 0.75% 03/31/26	2,200,000.00	2,006,726.56	
T 0.75% 04/30/26	2,150,000.00	1,957,507.81	
T 0.75% 05/31/26	1,200,000.00	1,090,500.00	
T 0.75% 08/31/26	2,050,000.00	1,853,328.12	
T 0.75% 11/15/24	3,000,000.00	2,832,421.89	
T 0.75% 12/31/23	2,000,000.00	1,931,250.00	
T 0.875% 06/30/26	1,000,000.00	911,679.69	



T 0.875% 09/30/26	2,500,000.00	2,268,847.65
T 0.875% 11/15/30	2,630,000.00	2,222,966.41
T 1.125% 02/15/31	3,190,000.00	2,744,895.31
T 1.125% 02/28/25	1,300,000.00	1,229,769.52
T 1.125% 02/28/27	800,000.00	729,000.00
T 1.125% 02/29/28	2,100,000.00	1,878,925.77
T 1.125% 05/15/40	870,000.00	601,931.25
T 1.125% 08/15/40	1,530,000.00	1,049,484.37
T 1.125% 08/31/28	1,400,000.00	1,240,914.06
T 1.125% 10/31/26	3,700,000.00	3,387,089.85
T 1.25% 03/31/28	2,320,000.00	2,085,825.00
T 1.25% 04/30/28	1,400,000.00	1,256,882.81
T 1.25% 05/15/50	1,800,000.00	1,132,031.25
T 1.25% 05/31/28	2,300,000.00	2,061,914.07
T 1.25% 06/30/28	1,150,000.00	1,029,564.45
T 1.25% 08/15/31	4,450,000.00	3,831,171.87
T 1.25% 08/31/24	380,000.00	364,562.50
T 1.25% 09/30/28	3,100,000.00	2,764,328.12
T 1.25% 11/30/26	1,600,000.00	1,470,875.00
T 1.25% 12/31/26	1,300,000.00	1,193,460.94
T 1.375% 01/31/25	300,000.00	286,031.25
T 1.375% 08/15/50	1,550,000.00	1,008,347.66
T 1.375% 08/31/26	440,000.00	408,289.06
T 1.375% 09/30/23	600,000.00	587,753.90
T 1.375% 10/31/28	3,000,000.00	2,692,265.64
T 1.375% 11/15/31	3,160,000.00	2,737,843.75
T 1.375% 11/15/40	1,390,000.00	993,415.62
T 1.5% 01/31/27	600,000.00	556,359.37
T 1.5% 02/15/30	1,770,000.00	1,586,915.62
T 1.5% 08/15/26	1,880,000.00	1,753,026.56
T 1.5% 09/30/24	260,000.00	250,300.78
T 1.5% 10/31/24	260,000.00	249,914.84
T 1.5% 11/30/24	2,200,000.00	2,110,882.81
T 1.5% 11/30/28	3,160,000.00	2,854,368.75
T 1.625% 02/15/26	2,200,000.00	2,074,960.93
T 1.625% 05/15/26	920,000.00	865,123.43
T 1.625% 05/15/31	3,410,000.00	3,046,355.48
T 1.625% 08/15/29	1,300,000.00	1,181,375.00
T 1.625% 09/30/26	330,000.00	309,194.53
T 1.625% 10/31/23	920,000.00	902,103.12
T 1.625% 10/31/26	260,000.00	243,150.78
T 1.625% 11/15/50	1,320,000.00	918,431.25
T 1.625% 11/30/26	400,000.00	373,984.37

T 1.75% 01/31/29	750,000.00	687,832.03
T 1.75% 03/15/25	1,100,000.00	1,056,472.65
T 1.75% 06/30/24	1,210,000.00	1,175,094.33
T 1.75% 07/31/24	260,000.00	252,240.62
T 1.75% 08/15/41	2,440,000.00	1,846,012.50
T 1.75% 11/15/29	1,050,000.00	962,718.75
T 1.75% 12/31/24	450,000.00	433,722.65
T 1.75% 12/31/26	900,000.00	845,121.09
T 1.875% 02/15/32	2,260,000.00	2,043,534.37
T 1.875% 02/15/41	1,520,000.00	1,184,175.00
T 1.875% 02/15/51	2,080,000.00	1,542,937.51
T 1.875% 06/30/26	100,000.00	94,898.43
T 1.875% 07/31/26	230,000.00	217,933.98
T 1.875% 08/31/24	660,000.00	641,037.88
T 1.875% 11/15/51	1,170,000.00	866,165.62
T 1% 07/31/28	1,820,000.00	1,603,235.16
T 1% 12/15/24	2,000,000.00	1,895,390.62
T 2.125% 02/29/24	240,000.00	235,626.56
T 2.125% 03/31/24	390,000.00	382,573.24
T 2.125% 05/15/25	280,000.00	270,790.62
T 2.125% 05/31/26	420,000.00	402,281.25
T 2.125% 07/31/24	160,000.00	156,356.24
T 2.125% 09/30/24	650,000.00	634,029.29
T 2.125% 11/30/23	500,000.00	492,431.64
T 2.125% 11/30/24	400,000.00	389,125.00
T 2.25% 01/31/24	220,000.00	216,588.28
T 2.25% 02/15/27	1,120,000.00	1,071,918.74
T 2.25% 02/15/52	1,300,000.00	1,055,437.50
T 2.25% 03/31/26	220,000.00	211,947.65
T 2.25% 04/30/24	550,000.00	539,999.02
T 2.25% 05/15/41	1,570,000.00	1,302,118.75
T 2.25% 08/15/27	1,440,000.00	1,375,031.24
T 2.25% 08/15/46	780,000.00	620,892.19
T 2.25% 08/15/49	1,010,000.00	822,597.66
T 2.25% 10/31/24	300,000.00	292,980.46
T 2.25% 11/15/24	3,240,000.00	3,163,303.14
T 2.25% 11/15/25	1,840,000.00	1,776,031.25
T 2.25% 11/15/27	640,000.00	609,824.99
T 2.25% 12/31/23	210,000.00	206,911.52
T 2.25% 12/31/24	260,000.00	253,398.43
T 2.375% 02/15/42	1,200,000.00	1,011,937.50
T 2.375% 02/29/24	400,000.00	394,164.06

T 2.375% 03/31/29	1,330,000.00	1,265,162.50
T 2.375% 04/30/26	310,000.00	299,973.43
T 2.375% 05/15/27	1,740,000.00	1,672,710.94
T 2.375% 05/15/29	1,490,000.00	1,417,595.31
T 2.375% 05/15/51	2,800,000.00	2,341,718.76
T 2.375% 08/15/24	2,650,000.00	2,600,778.31
T 2.375% 11/15/49	1,060,000.00	887,584.37
T 2.5% 01/31/24	700,000.00	691,414.06
T 2.5% 01/31/25	330,000.00	323,219.53
T 2.5% 02/15/45	810,000.00	680,779.68
T 2.5% 02/15/46	520,000.00	435,703.12
T 2.5% 02/28/26	1,500,000.00	1,457,460.94
T 2.5% 05/15/24	1,160,000.00	1,143,347.65
T 2.5% 05/15/46	430,000.00	360,158.59
T 2.5% 05/31/24	2,100,000.00	2,068,458.98
T 2.625% 01/31/26	290,000.00	283,157.81
T 2.625% 02/15/29	1,150,000.00	1,112,085.93
T 2.625% 03/31/25	330,000.00	323,838.28
T 2.625% 04/15/25	900,000.00	882,527.34
T 2.625% 12/31/23	700,000.00	693,396.48
T 2.625% 12/31/25	250,000.00	244,199.22
T 2.75% 02/15/24	2,250,000.00	2,229,960.93
T 2.75% 02/15/28	100,000.00	97,542.96
T 2.75% 02/28/25	550,000.00	541,556.64
T 2.75% 05/31/29	800,000.00	778,875.00
T 2.75% 06/30/25	190,000.00	186,734.37
T 2.75% 08/15/42	360,000.00	321,778.12
T 2.75% 08/15/47	790,000.00	697,236.72
T 2.75% 08/31/25	230,000.00	225,786.32
T 2.75% 11/15/23	2,210,000.00	2,193,856.63
T 2.75% 11/15/42	490,000.00	437,095.31
T 2.75% 11/15/47	850,000.00	751,453.12
T 2.875% 04/30/25	880,000.00	868,037.50
T 2.875% 05/15/28	2,180,000.00	2,138,614.07
T 2.875% 05/15/32	480,000.00	473,175.00
T 2.875% 05/15/43	700,000.00	634,757.81
T 2.875% 05/15/49	1,030,000.00	951,462.50
T 2.875% 05/15/52	570,000.00	533,350.77
T 2.875% 05/31/25	1,460,000.00	1,439,810.93
T 2.875% 07/31/25	500,000.00	492,871.09
T 2.875% 08/15/28	920,000.00	902,426.56
T 2.875% 08/15/45	550,000.00	494,226.56
T 2.875% 09/30/23	320,000.00	318,612.49

T 2.875% 10/31/23	230,000.00	228,782.61	
T 2.875% 11/15/46	550,000.00	495,171.87	
T 2.875% 11/30/23	500,000.00	497,031.25	
T 2.875% 11/30/25	540,000.00	531,689.06	
T 2% 02/15/25	1,480,000.00	1,432,015.63	
T 2% 02/15/50	1,170,000.00	899,437.50	
T 2% 04/30/24	140,000.00	136,926.56	
T 2% 05/31/24	1,120,000.00	1,093,859.37	
T 2% 06/30/24	260,000.00	253,687.89	
T 2% 08/15/25	650,000.00	624,482.42	
T 2% 08/15/51	2,600,000.00	1,984,937.50	
T 2% 11/15/26	1,650,000.00	1,565,244.13	
T 2% 11/15/41	1,650,000.00	1,305,046.87	
T 3.125% 02/15/42	180,000.00	171,928.12	
T 3.125% 02/15/43	680,000.00	642,759.37	
T 3.125% 05/15/48	1,260,000.00	1,204,185.93	
T 3.125% 08/15/44	570,000.00	535,577.34	
T 3.125% 11/15/28	3,630,000.00	3,612,133.61	
T 3.125% 11/15/41	330,000.00	315,742.97	
T 3.375% 05/15/44	410,000.00	401,800.00	
T 3.375% 11/15/48	910,000.00	915,189.84	
T 3.5% 02/15/39	100,000.00	104,023.43	
T 3.625% 02/15/44	590,000.00	601,200.78	
T 3.625% 08/15/43	570,000.00	582,067.97	
T 3.75% 08/15/41	260,000.00	272,593.75	
T 3.75% 11/15/43	570,000.00	592,844.53	
T 3.875% 08/15/40	390,000.00	419,280.47	
T 3% 02/15/47	730,000.00	672,683.59	
T 3% 02/15/48	710,000.00	660,355.47	
T 3% 02/15/49	1,460,000.00	1,378,901.56	
T 3% 05/15/42	370,000.00	345,863.28	
T 3% 05/15/45	480,000.00	440,737.50	
T 3% 05/15/47	380,000.00	350,579.68	
T 3% 08/15/48	1,250,000.00	1,169,140.62	
T 3% 09/30/25	460,000.00	454,950.78	
T 3% 10/31/25	270,000.00	266,941.40	
T 3% 11/15/44	840,000.00	771,684.37	
T 3% 11/15/45	610,000.00	560,961.72	
T 4.25% 05/15/39	620,000.00	706,073.43	
T 4.25% 11/15/40	200,000.00	225,625.00	
T 4.375% 02/15/38	210,000.00	242,976.56	
T 4.375% 05/15/40	300,000.00	345,117.18	

	T 4.375% 05/15/41	800,000.00	915,500.00	
	T 4.375% 11/15/39	350,000.00	403,839.84	
	T 4.5% 02/15/36	310,000.00	361,973.43	
	T 4.5% 05/15/38	110,000.00	128,906.25	
	T 4.5% 08/15/39	350,000.00	410,292.97	
	T 4.625% 02/15/40	160,000.00	190,162.50	
	T 4.75% 02/15/41	150,000.00	180,386.71	
	T 5.0% 05/15/37	250,000.00	307,207.03	
	T 5.25% 11/15/28	150,000.00	167,056.64	
	T 5.375% 02/15/31	60,000.00	70,181.25	
	T 6.0% 02/15/26	420,000.00	455,814.84	
	T 6.25% 05/15/30	90,000.00	109,328.90	
	アメリカドル 小計	271,840,000.00	248,965,334.95 (34,441,864,436)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	480,000.00	431,390.40	
	CAN 0.25% 04/01/24	280,000.00	265,930.00	
	CAN 0.25% 08/01/23	580,000.00	562,089.60	
	CAN 0.5% 09/01/25	860,000.00	788,792.00	
	CAN 0.5% 11/01/23	500,000.00	482,060.00	
	CAN 0.5% 12/01/30	680,000.00	554,404.00	
	CAN 0.75% 10/01/24	170,000.00	160,699.30	
	CAN 1.25% 03/01/25	430,000.00	407,222.90	
	CAN 1.25% 03/01/27	290,000.00	266,573.80	
	CAN 1.25% 06/01/30	990,000.00	868,824.00	
	CAN 1.5% 04/01/25	90,000.00	85,634.10	
	CAN 1.5% 05/01/24	70,000.00	67,677.40	
	CAN 1.5% 06/01/26	170,000.00	159,487.20	
	CAN 1.5% 06/01/31	940,000.00	829,559.40	
	CAN 1.5% 09/01/24	490,000.00	471,233.00	
	CAN 1.5% 12/01/31	830,000.00	727,959.80	
	CAN 1.75% 12/01/53	610,000.00	458,427.20	
	CAN 1% 06/01/27	340,000.00	307,910.80	
	CAN 1% 09/01/26	420,000.00	384,749.40	
	CAN 2.25% 03/01/24	60,000.00	58,861.80	
	CAN 2.25% 06/01/25	160,000.00	155,192.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	270,000.00	257,077.80	
	CAN 2.5% 06/01/24	270,000.00	265,396.50	
	CAN 2.75% 08/01/24	390,000.00	384,329.40	
	CAN 2.75% 09/01/27	100,000.00	98,062.00	
	CAN 2.75% 12/01/48	320,000.00	306,188.80	
	CAN 2.75% 12/01/64	160,000.00	150,929.60	
	CAN 2% 06/01/28	150,000.00	141,334.50	
	CAN 2% 06/01/32	450,000.00	411,331.50	

	CAN 2% 09/01/23	990,000.00	973,556.10
	CAN 2% 12/01/51	920,000.00	743,866.00
	CAN 3.5% 12/01/45	300,000.00	324,054.00
	CAN 4.0% 06/01/41	190,000.00	215,817.20
	CAN 5.75% 06/01/29	220,000.00	256,071.20
	CAN 5.75% 06/01/33	260,000.00	323,138.40
	CAN 5% 06/01/37	120,000.00	147,510.00
	<b>カナダドル 小計</b>	<b>14,550,000.00</b>	<b>13,493,341.10</b> <b>(1,428,809,889)</b>
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	1,500,000.00	1,635,795.00
	MBONO 10% 12/05/24	6,060,000.00	6,126,538.80
	MBONO 5.5% 03/04/27	2,250,000.00	1,959,660.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	11,700,000.00	10,515,960.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	7,760,000.00	7,313,722.40
	MBONO 7.75% 05/29/31	9,030,000.00	8,400,879.90
	MBONO 7.75% 11/13/42	5,800,000.00	5,134,740.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	2,100,000.00	1,924,461.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	9,070,000.00	8,883,611.50
	MBONO 8.5% 11/18/38	6,180,000.00	5,926,558.20
	MBONO 8% 07/31/53	240,000.00	218,848.80
	MBONO 8% 09/05/24	9,190,000.00	8,932,220.50
	MBONO 8% 11/07/47	6,310,000.00	5,734,969.70
	MBONO 8% 12/07/23	5,340,000.00	5,217,874.20
	<b>メキシコペソ 小計</b>	<b>82,530,000.00</b>	<b>77,925,840.00</b> <b>(537,119,437)</b>
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	350,000.00	308,539.00
	BGB 0.2% 10/22/23	280,000.00	277,874.80
	BGB 0.35% 06/22/32	180,000.00	153,266.40
	BGB 0.4% 06/22/40	200,000.00	139,978.00
	BGB 0.5% 10/22/24	270,000.00	266,994.90
	BGB 0.65% 06/22/71	150,000.00	72,276.00
	BGB 0.8% 06/22/25	550,000.00	544,615.50
	BGB 0.8% 06/22/27	330,000.00	320,463.00
	BGB 0.8% 06/22/28	610,000.00	585,905.00
	BGB 0.9% 06/22/29	420,000.00	400,054.20
	BGB 0% 10/22/27	330,000.00	305,860.50
	BGB 0% 10/22/31	550,000.00	462,753.50
	BGB 1.25% 04/22/33	250,000.00	232,380.00
	BGB 1.4% 06/22/53	240,000.00	178,716.00
	BGB 1.45% 06/22/37	140,000.00	123,834.20
	BGB 1.6% 06/22/47	260,000.00	214,731.40
	BGB 1.7% 06/22/50	290,000.00	240,009.80

BGB 1.9% 06/22/38	210,000.00	196,266.00
BGB 1% 06/22/26	370,000.00	366,015.10
BGB 1% 06/22/31	450,000.00	419,805.00
BGB 2.15% 06/22/66	180,000.00	160,790.40
BGB 2.25% 06/22/57	160,000.00	147,494.40
BGB 2.6% 06/22/24	380,000.00	391,126.40
BGB 3.75% 06/22/45	260,000.00	312,751.40
BGB 3% 06/22/34	210,000.00	226,905.00
BGB 4.25% 03/28/41	450,000.00	562,792.50
BGB 4.5% 03/28/26	320,000.00	356,169.60
BGB 4% 03/28/32	170,000.00	201,186.50
BGB 5.5% 03/28/28	360,000.00	437,929.20
BGB 5% 03/28/35	520,000.00	675,500.80
BKO 0.2% 06/14/24	320,000.00	316,262.40
BKO 0% 09/15/23	640,000.00	635,968.00
BKO 0% 12/15/23	930,000.00	922,113.60
BTPS 0.25% 03/15/28	250,000.00	215,870.00
BTPS 0.3% 08/15/23	260,000.00	257,610.60
BTPS 0.35% 02/01/25	270,000.00	258,954.30
BTPS 0.45% 02/15/29	610,000.00	516,090.50
BTPS 0.5% 02/01/26	550,000.00	515,328.00
BTPS 0.5% 07/15/28	510,000.00	442,088.40
BTPS 0.6% 08/01/31	620,000.00	484,554.80
BTPS 0.65% 10/15/23	680,000.00	674,906.80
BTPS 0.85% 01/15/27	780,000.00	722,989.80
BTPS 0.9% 04/01/31	710,000.00	576,867.90
BTPS 0.95% 03/01/37	480,000.00	333,681.60
BTPS 0.95% 06/01/32	310,000.00	243,982.40
BTPS 0.95% 08/01/30	510,000.00	425,640.90
BTPS 0.95% 09/15/27	540,000.00	493,792.20
BTPS 0.95% 12/01/31	590,000.00	471,681.40
BTPS 0% 01/30/24	250,000.00	244,627.50
BTPS 0% 04/01/26	600,000.00	548,238.00
BTPS 0% 04/15/24	720,000.00	700,617.60
BTPS 0% 08/01/26	510,000.00	461,565.30
BTPS 0% 08/15/24	560,000.00	539,672.00
BTPS 1.1% 04/01/27	430,000.00	399,689.30
BTPS 1.25% 12/01/26	480,000.00	454,761.60
BTPS 1.35% 04/01/30	480,000.00	419,016.00
BTPS 1.45% 03/01/36	290,000.00	224,138.10
BTPS 1.45% 05/15/25	350,000.00	342,426.00
BTPS 1.45% 11/15/24	1,000,000.00	988,280.00
BTPS 1.5% 04/30/45	270,000.00	177,981.30

BTPS 1.5% 06/01/25	500,000.00	490,610.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	390,000.00	377,820.30	
BTPS 1.65% 03/01/32	740,000.00	630,842.60	
BTPS 1.65% 12/01/30	540,000.00	473,796.00	
BTPS 1.7% 09/01/51	330,000.00	213,912.60	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	998,510.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	460,000.00	339,857.20	
BTPS 1.85% 05/15/24	530,000.00	530,593.60	
BTPS 1.85% 07/01/25	530,000.00	523,428.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	720,000.00	696,405.60	
BTPS 2.1% 07/15/26	840,000.00	826,988.40	
BTPS 2.15% 03/01/72	120,000.00	80,218.80	
BTPS 2.15% 09/01/52	280,000.00	197,453.20	
BTPS 2.2% 06/01/27	350,000.00	341,775.00	
BTPS 2.25% 09/01/36	540,000.00	456,132.60	
BTPS 2.45% 09/01/33	560,000.00	500,270.40	
BTPS 2.45% 09/01/50	390,000.00	300,366.30	
BTPS 2.45% 10/01/23	770,000.00	779,447.90	
BTPS 2.5% 11/15/25	280,000.00	281,058.40	
BTPS 2.5% 12/01/24	430,000.00	434,704.20	
BTPS 2.5% 12/01/32	250,000.00	225,660.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	450,000.00	374,044.50	
BTPS 2.8% 03/01/67	220,000.00	174,409.40	
BTPS 2.8% 06/15/29	290,000.00	283,454.70	
BTPS 2.8% 12/01/28	440,000.00	435,463.60	
BTPS 2.95% 09/01/38	420,000.00	380,049.60	
BTPS 2% 02/01/28	830,000.00	794,758.20	
BTPS 2% 12/01/25	600,000.00	593,526.00	
BTPS 3.1% 03/01/40	260,000.00	237,536.00	
BTPS 3.25% 03/01/38	190,000.00	177,902.70	
BTPS 3.25% 09/01/46	460,000.00	423,006.80	
BTPS 3.35% 03/01/35	610,000.00	588,015.60	
BTPS 3.45% 03/01/48	440,000.00	415,157.60	
BTPS 3.5% 03/01/30	490,000.00	500,388.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	200,000.00	207,226.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	350,000.00	350,371.00	
BTPS 3% 08/01/29	810,000.00	803,633.40	
BTPS 4.5% 03/01/24	680,000.00	708,736.80	
BTPS 4.5% 03/01/26	610,000.00	653,663.80	
BTPS 4.75% 08/01/23	600,000.00	619,152.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	590,000.00	646,781.60	
BTPS 4.75% 09/01/44	490,000.00	558,854.80	



BTPS 4% 02/01/37	490,000.00	507,355.80
BTPS 5.0% 08/01/39	590,000.00	681,526.70
BTPS 5.25% 11/01/29	750,000.00	854,422.50
BTPS 5.75% 02/01/33	490,000.00	579,866.00
BTPS 5% 03/01/25	580,000.00	621,354.00
BTPS 5% 08/01/34	550,000.00	619,943.50
BTPS 5% 09/01/40	460,000.00	531,985.40
BTPS 6.5% 11/01/27	500,000.00	591,520.00
BTPS 6% 05/01/31	480,000.00	574,804.80
DBR 0.25% 02/15/27	940,000.00	907,410.20
DBR 0.25% 02/15/29	570,000.00	537,390.30
DBR 0.25% 08/15/28	530,000.00	501,931.20
DBR 0.5% 02/15/25	610,000.00	603,863.40
DBR 0.5% 02/15/26	680,000.00	668,548.80
DBR 0.5% 02/15/28	700,000.00	675,731.00
DBR 0.5% 08/15/27	540,000.00	524,647.80
DBR 0% 02/15/30	580,000.00	530,636.20
DBR 0% 02/15/31	790,000.00	711,150.10
DBR 0% 02/15/32	850,000.00	750,184.50
DBR 0% 05/15/35	550,000.00	456,395.50
DBR 0% 05/15/36	620,000.00	505,486.00
DBR 0% 08/15/26	940,000.00	902,635.00
DBR 0% 08/15/29	350,000.00	322,367.50
DBR 0% 08/15/30	850,000.00	771,196.50
DBR 0% 08/15/31	820,000.00	731,661.40
DBR 0% 08/15/50	1,080,000.00	711,590.40
DBR 0% 08/15/52	380,000.00	242,538.80
DBR 0% 11/15/27	600,000.00	565,650.00
DBR 0% 11/15/28	560,000.00	520,984.80
DBR 1.25% 08/15/48	790,000.00	748,651.40
DBR 1.5% 05/15/24	810,000.00	819,914.40
DBR 1.7% 08/15/32	210,000.00	216,064.80
DBR 1.75% 02/15/24	510,000.00	517,838.70
DBR 1% 05/15/38	180,000.00	166,345.20
DBR 1% 08/15/24	700,000.00	701,589.00
DBR 1% 08/15/25	700,000.00	700,714.00
DBR 2.5% 07/04/44	710,000.00	841,286.10
DBR 2.5% 08/15/46	740,000.00	890,434.60
DBR 2% 08/15/23	150,000.00	152,035.50
DBR 3.25% 07/04/42	480,000.00	624,148.80
DBR 4.0% 01/04/37	700,000.00	923,748.00
DBR 4.25% 07/04/39	460,000.00	643,820.60
DBR 4.75% 07/04/28	570,000.00	684,381.90

DBR 4.75% 07/04/34	530,000.00	724,759.10
DBR 4.75% 07/04/40	520,000.00	779,012.00
DBR 5.5% 01/04/31	660,000.00	882,651.00
DBR 5.625% 01/04/28	690,000.00	848,196.30
DBR 6.25% 01/04/24	210,000.00	225,605.10
DBR 6.25% 01/04/30	490,000.00	663,690.30
DBR 6.5% 07/04/27	110,000.00	137,561.60
FRTR 0.25% 11/25/26	1,040,000.00	991,692.00
FRTR 0.5% 05/25/25	1,380,000.00	1,354,180.20
FRTR 0.5% 05/25/26	1,290,000.00	1,251,570.90
FRTR 0.5% 05/25/29	1,100,000.00	1,022,582.00
FRTR 0.5% 05/25/40	570,000.00	418,425.60
FRTR 0.5% 05/25/72	250,000.00	114,050.00
FRTR 0.5% 06/25/44	370,000.00	250,786.00
FRTR 0.75% 02/25/28	690,000.00	660,474.90
FRTR 0.75% 05/25/28	1,330,000.00	1,272,716.90
FRTR 0.75% 05/25/52	800,000.00	515,264.00
FRTR 0.75% 05/25/53	520,000.00	327,147.60
FRTR 0.75% 11/25/28	1,370,000.00	1,303,500.20
FRTR 0% 02/25/24	790,000.00	780,883.40
FRTR 0% 02/25/25	550,000.00	533,830.00
FRTR 0% 02/25/26	1,180,000.00	1,128,764.40
FRTR 0% 02/25/27	970,000.00	910,044.30
FRTR 0% 03/25/24	1,040,000.00	1,026,656.80
FRTR 0% 03/25/25	1,410,000.00	1,367,559.00
FRTR 0% 05/25/32	770,000.00	639,731.40
FRTR 0% 11/25/29	1,280,000.00	1,136,857.60
FRTR 0% 11/25/30	1,240,000.00	1,073,381.20
FRTR 0% 11/25/31	1,260,000.00	1,064,851.20
FRTR 1.25% 05/25/34	870,000.00	789,411.90
FRTR 1.25% 05/25/36	1,190,000.00	1,052,090.90
FRTR 1.25% 05/25/38	70,000.00	60,116.70
FRTR 1.5% 05/25/31	1,340,000.00	1,312,543.40
FRTR 1.5% 05/25/50	810,000.00	658,035.90
FRTR 1.75% 05/25/66	390,000.00	316,243.20
FRTR 1.75% 06/25/39	910,000.00	845,280.80
FRTR 1.75% 11/25/24	750,000.00	760,777.50
FRTR 1% 05/25/27	930,000.00	911,297.70
FRTR 1% 11/25/25	1,400,000.00	1,389,528.00
FRTR 2.25% 05/25/24	520,000.00	531,830.00
FRTR 2.5% 05/25/30	1,230,000.00	1,305,927.90
FRTR 2.75% 10/25/27	1,330,000.00	1,414,348.60

FRTR 2% 05/25/48	810,000.00	742,794.30
FRTR 3.25% 05/25/45	750,000.00	857,542.50
FRTR 3.5% 04/25/26	1,200,000.00	1,294,380.00
FRTR 4.25% 10/25/23	1,490,000.00	1,550,225.80
FRTR 4.5% 04/25/41	970,000.00	1,278,654.00
FRTR 4.75% 04/25/35	810,000.00	1,041,165.90
FRTR 4% 04/25/55	520,000.00	691,652.00
FRTR 4% 04/25/60	390,000.00	530,501.40
FRTR 4% 10/25/38	570,000.00	700,273.50
FRTR 5.5% 04/25/29	1,040,000.00	1,293,895.20
FRTR 5.75% 10/25/32	940,000.00	1,268,163.40
IRISH 0.2% 05/15/27	180,000.00	169,806.60
IRISH 0.2% 10/18/30	340,000.00	299,019.80
IRISH 0.35% 10/18/32	150,000.00	127,296.00
IRISH 0.4% 05/15/35	100,000.00	80,319.00
IRISH 0.55% 04/22/41	100,000.00	72,536.00
IRISH 0.9% 05/15/28	180,000.00	173,246.40
IRISH 0% 10/18/31	170,000.00	142,800.00
IRISH 1.1% 05/15/29	230,000.00	221,646.40
IRISH 1.3% 05/15/33	130,000.00	120,407.30
IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	231,775.20
IRISH 1.5% 05/15/50	180,000.00	144,568.80
IRISH 1.7% 05/15/37	180,000.00	167,907.60
IRISH 1% 05/15/26	290,000.00	287,018.80
IRISH 2.4% 05/15/30	110,000.00	115,641.90
IRISH 2% 02/18/45	260,000.00	241,207.20
IRISH 3.4% 03/18/24	240,000.00	248,872.80
IRISH 5.4% 03/13/25	270,000.00	298,460.70
NETHER 0.25% 07/15/25	410,000.00	399,651.60
NETHER 0.25% 07/15/29	380,000.00	349,432.80
NETHER 0.5% 01/15/40	300,000.00	239,472.00
NETHER 0.5% 07/15/26	410,000.00	398,630.70
NETHER 0.5% 07/15/32	370,000.00	329,392.50
NETHER 0.75% 07/15/27	350,000.00	340,312.00
NETHER 0.75% 07/15/28	490,000.00	471,512.30
NETHER 0% 01/15/24	360,000.00	355,809.60
NETHER 0% 01/15/26	270,000.00	259,081.20
NETHER 0% 01/15/27	420,000.00	396,559.80
NETHER 0% 01/15/29	220,000.00	199,986.60
NETHER 0% 01/15/38	230,000.00	172,334.40
NETHER 0% 01/15/52	360,000.00	209,592.00
NETHER 0% 07/15/30	310,000.00	275,298.60
NETHER 0% 07/15/31	310,000.00	269,762.00

NETHER 2.5% 01/15/33	380,000.00	407,181.40	
NETHER 2.75% 01/15/47	500,000.00	588,625.00	
NETHER 2% 07/15/24	450,000.00	458,982.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	490,000.00	636,892.20	
NETHER 4% 01/15/37	410,000.00	518,420.40	
NETHER 5.5% 01/15/28	350,000.00	424,084.50	
OBL 0% 04/05/24	700,000.00	691,859.00	
OBL 0% 04/10/26	760,000.00	733,073.20	
OBL 0% 04/11/25	660,000.00	644,153.40	
OBL 0% 04/16/27	550,000.00	522,857.50	
OBL 0% 10/09/26	500,000.00	478,180.00	
OBL 0% 10/10/25	630,000.00	611,282.70	
OBL 0% 10/13/23	180,000.00	178,761.60	
OBL 0% 10/18/24	520,000.00	510,016.00	
RAGB 0.25% 10/20/36	130,000.00	99,582.60	
RAGB 0.5% 02/20/29	430,000.00	398,971.20	
RAGB 0.5% 04/20/27	200,000.00	191,880.00	
RAGB 0.7% 04/20/71	90,000.00	48,616.20	
RAGB 0.75% 02/20/28	320,000.00	305,865.60	
RAGB 0.75% 03/20/51	170,000.00	116,983.80	
RAGB 0.75% 10/20/26	470,000.00	459,147.70	
RAGB 0.85% 06/30/20	80,000.00	37,698.40	
RAGB 0.9% 02/20/32	200,000.00	180,984.00	
RAGB 0% 02/20/30	310,000.00	271,606.50	
RAGB 0% 02/20/31	320,000.00	273,212.80	
RAGB 0% 04/20/25	230,000.00	222,692.90	
RAGB 0% 07/15/24	300,000.00	294,126.00	
RAGB 0% 10/20/40	110,000.00	73,013.60	
RAGB 1.2% 10/20/25	350,000.00	349,818.00	
RAGB 1.5% 02/20/47	240,000.00	208,365.60	
RAGB 1.5% 11/02/86	70,000.00	50,568.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	350,000.00	353,958.50	
RAGB 1.75% 10/20/23	160,000.00	161,670.40	
RAGB 1.85% 05/23/49	100,000.00	92,009.00	
RAGB 2.1% 09/20/17	170,000.00	148,097.20	
RAGB 2.4% 05/23/34	230,000.00	237,302.50	
RAGB 3.15% 06/20/44	160,000.00	186,168.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	90,000.00	123,083.10	
RAGB 4.15% 03/15/37	380,000.00	471,306.40	
RAGB 4.85% 03/15/26	200,000.00	224,918.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	220,000.00	270,487.80	
RFGB 0.125% 04/15/36	160,000.00	122,747.20	

RFGB 0.125% 04/15/52	90,000.00	51,065.10
RFGB 0.125% 09/15/31	180,000.00	154,584.00
RFGB 0.25% 09/15/40	120,000.00	85,202.40
RFGB 0.5% 04/15/26	210,000.00	204,380.40
RFGB 0.5% 04/15/43	90,000.00	64,305.00
RFGB 0.5% 09/15/27	140,000.00	133,477.40
RFGB 0.5% 09/15/28	140,000.00	131,318.60
RFGB 0.5% 09/15/29	110,000.00	101,536.60
RFGB 0.75% 04/15/31	130,000.00	119,354.30
RFGB 0.875% 09/15/25	70,000.00	69,332.90
RFGB 0% 09/15/23	100,000.00	99,196.00
RFGB 0% 09/15/24	140,000.00	137,075.40
RFGB 0% 09/15/26	100,000.00	94,606.00
RFGB 0% 09/15/30	160,000.00	139,152.00
RFGB 1.125% 04/15/34	70,000.00	63,333.90
RFGB 1.375% 04/15/47	100,000.00	86,015.00
RFGB 1.5% 09/15/32	60,000.00	57,555.60
RFGB 2.625% 07/04/42	140,000.00	148,335.60
RFGB 2.75% 07/04/28	150,000.00	160,200.00
RFGB 2% 04/15/24	160,000.00	163,040.00
RFGB 4% 07/04/25	130,000.00	140,567.70
SPGB 0.1% 04/30/31	490,000.00	404,740.00
SPGB 0.25% 07/30/24	610,000.00	598,178.20
SPGB 0.5% 04/30/30	680,000.00	600,256.40
SPGB 0.5% 10/31/31	600,000.00	506,562.00
SPGB 0.6% 10/31/29	630,000.00	566,968.50
SPGB 0.7% 04/30/32	530,000.00	449,084.90
SPGB 0.8% 07/30/27	690,000.00	657,059.40
SPGB 0.8% 07/30/29	450,000.00	411,858.00
SPGB 0.85% 07/30/37	310,000.00	233,709.00
SPGB 0% 01/31/25	530,000.00	512,700.80
SPGB 0% 01/31/26	750,000.00	709,462.50
SPGB 0% 01/31/27	330,000.00	305,052.00
SPGB 0% 01/31/28	450,000.00	406,075.50
SPGB 0% 05/31/24	140,000.00	137,253.20
SPGB 0% 05/31/25	130,000.00	124,576.40
SPGB 1.2% 10/31/40	360,000.00	270,817.20
SPGB 1.25% 10/31/30	460,000.00	425,914.00
SPGB 1.3% 10/31/26	590,000.00	581,769.50
SPGB 1.4% 04/30/28	500,000.00	486,590.00
SPGB 1.4% 07/30/28	690,000.00	668,699.70
SPGB 1.45% 04/30/29	370,000.00	356,354.40
SPGB 1.45% 10/31/27	400,000.00	392,252.00

	SPGB 1.45% 10/31/71	140,000.00	77,322.00	
	SPGB 1.5% 04/30/27	460,000.00	454,581.20	
	SPGB 1.6% 04/30/25	930,000.00	934,743.00	
	SPGB 1.85% 07/30/35	620,000.00	561,031.80	
	SPGB 1.9% 10/31/52	180,000.00	135,540.00	
	SPGB 1.95% 04/30/26	400,000.00	404,508.00	
	SPGB 1.95% 07/30/30	610,000.00	598,245.30	
	SPGB 1% 07/30/42	230,000.00	162,773.30	
	SPGB 1% 10/31/50	500,000.00	306,955.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	500,000.00	510,875.00	
	SPGB 2.35% 07/30/33	420,000.00	411,234.60	
	SPGB 2.55% 10/31/32	220,000.00	219,296.00	
	SPGB 2.7% 10/31/48	490,000.00	460,575.50	
	SPGB 2.75% 10/31/24	530,000.00	546,838.10	
	SPGB 2.9% 10/31/46	440,000.00	432,344.00	
	SPGB 3.45% 07/30/66	380,000.00	388,455.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	490,000.00	511,638.40	
	SPGB 4.2% 01/31/37	570,000.00	666,284.40	
	SPGB 4.4% 10/31/23	630,000.00	654,570.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	510,000.00	557,322.90	
	SPGB 4.7% 07/30/41	540,000.00	679,482.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	550,000.00	578,754.00	
	SPGB 4.9% 07/30/40	540,000.00	691,756.20	
	SPGB 5.15% 10/31/28	1,160,000.00	1,371,839.20	
	SPGB 5.15% 10/31/44	370,000.00	500,436.10	
	SPGB 5.75% 07/30/32	610,000.00	788,852.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	800,000.00	930,848.00	
	ユーロ 小計	166,260,000.00	163,192,497.60 (22,416,121,470)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	230,000.00	211,443.60	
	UKT 0.125% 01/31/24	790,000.00	759,245.30	
	UKT 0.125% 01/31/28	280,000.00	246,450.40	
	UKT 0.25% 01/31/25	670,000.00	629,203.70	
	UKT 0.25% 07/31/31	840,000.00	684,079.20	
	UKT 0.375% 10/22/26	540,000.00	492,134.40	
	UKT 0.375% 10/22/30	310,000.00	261,413.70	
	UKT 0.5% 01/31/29	120,000.00	105,369.60	
	UKT 0.5% 10/22/61	350,000.00	167,485.50	
	UKT 0.625% 06/07/25	180,000.00	170,463.60	
	UKT 0.625% 07/31/35	480,000.00	361,027.20	
	UKT 0.625% 10/22/50	300,000.00	171,141.00	
	UKT 0.875% 01/31/46	280,000.00	181,616.40	

UKT 0.875% 07/31/33	230,000.00	189,625.80	
UKT 0.875% 10/22/29	310,000.00	277,372.50	
UKT 1.125% 01/31/39	180,000.00	136,562.40	
UKT 1.125% 10/22/73	200,000.00	117,168.00	
UKT 1.25% 07/22/27	170,000.00	159,820.40	
UKT 1.25% 07/31/51	330,000.00	225,419.70	
UKT 1.25% 10/22/41	580,000.00	434,048.80	
UKT 1.5% 07/22/26	400,000.00	383,648.00	
UKT 1.5% 07/22/47	490,000.00	366,466.10	
UKT 1.5% 07/31/53	160,000.00	115,956.80	
UKT 1.625% 10/22/28	390,000.00	370,983.60	
UKT 1.625% 10/22/54	360,000.00	268,819.20	
UKT 1.625% 10/22/71	340,000.00	245,694.20	
UKT 1.75% 01/22/49	240,000.00	188,856.00	
UKT 1.75% 07/22/57	440,000.00	341,761.20	
UKT 1.75% 09/07/37	460,000.00	392,485.80	
UKT 1% 01/31/32	320,000.00	276,080.00	
UKT 1% 04/22/24	150,000.00	145,698.00	
UKT 2.25% 09/07/23	590,000.00	586,831.70	
UKT 2.5% 07/22/65	380,000.00	364,822.80	
UKT 2.75% 09/07/24	310,000.00	310,099.20	
UKT 2% 09/07/25	420,000.00	412,368.60	
UKT 3.25% 01/22/44	480,000.00	498,470.40	
UKT 3.5% 01/22/45	490,000.00	529,405.80	
UKT 3.5% 07/22/68	380,000.00	462,596.80	
UKT 3.75% 07/22/52	330,000.00	388,502.40	
UKT 4.25% 03/07/36	390,000.00	448,176.30	
UKT 4.25% 06/07/32	410,000.00	468,138.00	
UKT 4.25% 09/07/39	330,000.00	385,298.10	
UKT 4.25% 12/07/27	570,000.00	615,389.10	
UKT 4.25% 12/07/40	390,000.00	459,267.90	
UKT 4.25% 12/07/46	400,000.00	486,620.00	
UKT 4.25% 12/07/49	290,000.00	361,105.10	
UKT 4.25% 12/07/55	430,000.00	563,381.70	
UKT 4.5% 09/07/34	350,000.00	410,091.50	
UKT 4.5% 12/07/42	470,000.00	577,037.80	
UKT 4.75% 12/07/30	460,000.00	536,916.60	
UKT 4.75% 12/07/38	420,000.00	517,998.60	
UKT 4% 01/22/60	330,000.00	426,911.10	
UKT 5% 03/07/25	370,000.00	390,068.80	
UKT 6.0% 12/07/28	260,000.00	311,890.80	
イギリスポンド 小計	20,370,000.00	19,588,929.20	(3,165,179,180)

スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	1,160,000.00	996,254.40
	SGB 0.75% 05/12/28	1,900,000.00	1,773,080.00
	SGB 0.75% 11/12/29	1,440,000.00	1,327,032.00
	SGB 1.5% 11/13/23	2,660,000.00	2,643,986.80
	SGB 1% 11/12/26	1,920,000.00	1,835,059.20
	SGB 2.25% 06/01/32	1,240,000.00	1,285,842.80
	SGB 2.5% 05/12/25	1,880,000.00	1,892,351.60
	SGB 3.5% 03/30/39	1,120,000.00	1,387,243.20
スウェーデンクローナ 小計		13,320,000.00	13,140,850.00 (169,648,373)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	1,000,000.00	841,520.00
	NGB 1.375% 08/19/30	1,320,000.00	1,146,182.40
	NGB 1.5% 02/19/26	830,000.00	778,216.30
	NGB 1.75% 02/17/27	1,060,000.00	989,594.80
	NGB 1.75% 03/13/25	1,340,000.00	1,285,703.20
	NGB 1.75% 09/06/29	960,000.00	867,916.80
	NGB 2.125% 05/18/32	730,000.00	659,438.20
	NGB 2% 04/26/28	1,380,000.00	1,287,057.00
	NGB 3% 03/14/24	1,790,000.00	1,780,047.60
ノルウェークローネ 小計		10,410,000.00	9,635,676.30 (136,055,749)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	1,190,000.00	763,408.80
	DGB 0.5% 11/15/27	1,840,000.00	1,746,307.20
	DGB 0.5% 11/15/29	1,790,000.00	1,653,136.60
	DGB 0% 11/15/24	820,000.00	797,827.20
	DGB 0% 11/15/31	2,300,000.00	1,960,359.00
	DGB 1.5% 11/15/23	1,400,000.00	1,408,456.00
	DGB 1.75% 11/15/25	1,050,000.00	1,063,860.00
	DGB 4.5% 11/15/39	2,780,000.00	3,835,871.80
デンマーククローネ 小計		13,170,000.00	13,229,226.60 (244,343,815)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	740,000.00	570,976.60
	POLGB 0.75% 04/25/25	580,000.00	497,419.60
	POLGB 0% 07/25/24	370,000.00	324,023.80
	POLGB 1.25% 10/25/30	850,000.00	588,370.00
	POLGB 1.75% 04/25/32	290,000.00	197,806.10
	POLGB 2.25% 10/25/24	620,000.00	562,464.00
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,310,000.00	1,224,181.90
	POLGB 2.5% 07/25/26	1,350,000.00	1,157,152.50
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,050,000.00	872,739.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,210,000.00	1,004,324.20
	POLGB 2.75% 10/25/29	1,400,000.00	1,121,904.00



	POLGB 3.25% 07/25/25	1,090,000.00	988,128.60	
	POLGB 3.75% 05/25/27	290,000.00	255,585.70	
	POLGB 4% 10/25/23	290,000.00	281,369.60	
	ポーランドズロチ 小計	11,440,000.00	9,646,445.60 (279,191,287)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	650,000.00	610,122.50	
	ACGB 0.25% 11/21/25	400,000.00	362,980.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	580,000.00	517,998.00	
	ACGB 1.25% 05/21/32	500,000.00	405,075.00	
	ACGB 1.5% 06/21/31	690,000.00	583,043.10	
	ACGB 1.75% 06/21/51	450,000.00	284,314.50	
	ACGB 1.75% 11/21/32	430,000.00	362,752.30	
	ACGB 1% 11/21/31	740,000.00	590,927.00	
	ACGB 1% 12/21/30	490,000.00	400,624.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	420,000.00	394,737.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	780,000.00	727,061.40	
	ACGB 2.75% 04/21/24	490,000.00	487,986.10	
	ACGB 2.75% 05/21/41	340,000.00	287,170.80	
	ACGB 2.75% 06/21/35	300,000.00	269,919.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	400,000.00	387,748.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	160,000.00	153,867.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	330,000.00	314,420.70	
	ACGB 3.25% 04/21/25	390,000.00	390,089.70	
	ACGB 3.25% 04/21/29	500,000.00	493,815.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	230,000.00	212,655.70	
	ACGB 3.75% 04/21/37	340,000.00	337,752.60	
	ACGB 3% 03/21/47	340,000.00	291,189.60	
	ACGB 3% 11/21/33	290,000.00	272,814.60	
ACGB 4.25% 04/21/26	470,000.00	485,049.40		
ACGB 4.5% 04/21/33	620,000.00	668,335.20		
ACGB 4.75% 04/21/27	550,000.00	582,697.50		
	オーストラリアドル 小計	11,880,000.00	10,875,145.90 (1,032,377,600)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	210,000.00	196,211.40	
	SIGB 1.25% 11/01/26	70,000.00	66,027.50	
	SIGB 1.625% 07/01/31	100,000.00	90,013.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	240,000.00	187,886.40	
	SIGB 2.125% 06/01/26	120,000.00	117,763.20	
	SIGB 2.25% 08/01/36	160,000.00	146,771.20	
	SIGB 2.375% 06/01/25	180,000.00	178,711.20	
	SIGB 2.375% 07/01/39	70,000.00	64,285.90	
	SIGB 2.625% 05/01/28	120,000.00	118,998.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	170,000.00	161,127.70	

	SIGB 2.75% 04/01/42	160,000.00	152,651.20
	SIGB 2.875% 07/01/29	160,000.00	160,294.40
	SIGB 2.875% 09/01/30	270,000.00	269,997.30
	SIGB 2% 02/01/24	200,000.00	198,096.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	180,000.00	187,522.20
	SIGB 3.5% 03/01/27	320,000.00	330,275.20
	SIGB 3% 09/01/24	250,000.00	251,627.50
	シンガポールドル 小計	2,980,000.00	2,878,259.30 (284,746,192)
マレーシア リンギット	MGS 3.478% 06/14/24	90,000.00	90,351.90
	MGS 3.502% 05/31/27	360,000.00	357,120.00
	MGS 3.733% 06/15/28	590,000.00	586,318.40
	MGS 3.757% 05/22/40	580,000.00	534,545.40
	MGS 3.8% 08/17/23	230,000.00	232,240.20
	MGS 3.828% 07/05/34	500,000.00	484,605.00
	MGS 3.844% 04/15/33	290,000.00	284,185.50
	MGS 3.882% 03/14/25	530,000.00	537,732.70
	MGS 3.885% 08/15/29	410,000.00	409,618.70
	MGS 3.892% 03/15/27	170,000.00	171,417.80
	MGS 3.899% 11/16/27	420,000.00	424,229.40
	MGS 3.9% 11/30/26	370,000.00	374,273.50
	MGS 3.906% 07/15/26	560,000.00	566,216.00
	MGS 3.955% 09/15/25	570,000.00	579,444.90
	MGS 4.059% 09/30/24	300,000.00	304,752.00
	MGS 4.065% 06/15/50	120,000.00	110,733.60
	MGS 4.181% 07/15/24	370,000.00	376,301.10
	MGS 4.232% 06/30/31	940,000.00	959,580.20
	MGS 4.254% 05/31/35	600,000.00	600,786.00
	MGS 4.392% 04/15/26	270,000.00	277,738.20
	MGS 4.498% 04/15/30	690,000.00	715,053.90
	MGS 4.642% 11/07/33	380,000.00	396,469.20
	MGS 4.736% 03/15/46	240,000.00	247,312.80
MGS 4.762% 04/07/37	140,000.00	148,177.40	
MGS 4.893% 06/08/38	310,000.00	329,319.20	
MGS 4.921% 07/06/48	810,000.00	855,432.90	
MGS 4.935% 09/30/43	550,000.00	584,782.00	
	マレーシアリンギット 小計	11,390,000.00	11,538,737.90 (356,137,375)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	270,000.00	264,767.61
	ILGOV 0.4% 10/31/24	350,000.00	333,704.14
	ILGOV 0.5% 02/27/26	290,000.00	268,814.57
	ILGOV 0.5% 04/30/25	610,000.00	577,016.56
	ILGOV 1.3% 04/30/32	100,000.00	87,448.48

	ILGOV 1.5% 05/31/37	480,000.00	392,021.45
	ILGOV 1.5% 11/30/23	730,000.00	722,679.47
	ILGOV 1.75% 08/31/25	510,000.00	496,839.89
	ILGOV 1% 03/31/30	730,000.00	643,424.19
	ILGOV 2.25% 09/28/28	240,000.00	233,403.01
	ILGOV 2% 03/31/27	360,000.00	348,816.96
	ILGOV 3.75% 03/31/24	510,000.00	519,315.81
	ILGOV 3.75% 03/31/47	650,000.00	692,514.09
	ILGOV 5.5% 01/31/42	510,000.00	679,440.46
	ILGOV 6.25% 10/30/26	390,000.00	443,499.29
	イスラエルシェケル 小計	6,730,000.00	6,703,705.98 (281,766,147)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	4,180,000.00	4,154,167.60
	CGB 2.18% 06/25/24	1,450,000.00	1,452,421.50
	CGB 2.26% 02/24/25	2,020,000.00	2,023,191.60
	CGB 2.47% 09/02/24	3,260,000.00	3,282,591.80
	CGB 2.48% 04/15/27	3,200,000.00	3,206,016.00
	CGB 2.56% 10/21/23	7,560,000.00	7,613,600.40
	CGB 2.68% 05/21/30	2,720,000.00	2,718,531.20
	CGB 2.69% 08/12/26	3,100,000.00	3,135,154.00
	CGB 2.75% 02/17/32	3,150,000.00	3,158,064.00
	CGB 2.8% 03/24/29	3,100,000.00	3,134,162.00
	CGB 2.84% 04/08/24	4,210,000.00	4,263,382.80
	CGB 2.85% 06/04/27	2,850,000.00	2,901,756.00
	CGB 2.89% 11/18/31	900,000.00	911,412.00
	CGB 2.91% 10/14/28	3,790,000.00	3,858,788.50
	CGB 2.94% 10/17/24	2,000,000.00	2,034,860.00
	CGB 3.01% 05/13/28	4,920,000.00	5,042,950.80
	CGB 3.02% 05/27/31	2,330,000.00	2,384,988.00
	CGB 3.02% 10/22/25	4,500,000.00	4,604,265.00
	CGB 3.03% 03/11/26	6,730,000.00	6,897,105.90
	CGB 3.12% 12/05/26	1,300,000.00	1,338,493.00
	CGB 3.13% 11/21/29	2,050,000.00	2,115,313.00
	CGB 3.25% 11/22/28	1,700,000.00	1,767,779.00
	CGB 3.27% 11/19/30	1,380,000.00	1,440,706.20
	CGB 3.28% 12/03/27	1,170,000.00	1,217,981.70
	CGB 3.39% 03/16/50	2,370,000.00	2,455,343.70
	CGB 3.53% 10/18/51	290,000.00	310,491.40
	CGB 3.72% 04/12/51	2,380,000.00	2,616,381.60
	CGB 3.81% 09/14/50	1,450,000.00	1,615,474.00
	CGB 3.86% 07/22/49	1,470,000.00	1,646,811.60
	CGB 4.08% 10/22/48	1,510,000.00	1,748,172.30

	オフショア人民元 小計	83,040,000.00	85,050,356.60 (1,701,976,706)	
	合計		66,475,337,656 (66,475,337,656)	

## 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 232銘柄	100.0%	51.8%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 342銘柄	100.0%	33.7%
イギリスポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	4.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券 17銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 27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 30銘柄	100.0%	2.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 8月29日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	485,101,061
コール・ローン	3,664,455,763
国債証券	312,157,133,148
派生商品評価勘定	49,266,559
未収利息	1,724,964,267
前払金	42,544,428
前払費用	87,502,166
差入委託証拠金	628,564,833
流動資産合計	318,839,532,225
資産合計	318,839,532,225
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	49,174,112
未払金	13,138,976
未払解約金	58,656,346
未払利息	6,131
流動負債合計	120,975,565
負債合計	120,975,565
純資産の部	
元本等	
元本	101,070,365,995
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	217,648,190,665
元本等合計	318,718,556,660
純資産合計	318,718,556,660
負債純資産合計	318,839,532,225

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 8月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p>

	2022年 8月29日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2022年 8月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	101,070,365,995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 3.1534円 (1万口当たり純資産額) (31,534円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2022年 8月29日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年 8月29日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月29日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	96,783,804,165円
期中追加設定元本額	18,297,322,268円
期中一部解約元本額	14,010,760,438円
期末元本額	101,070,365,995円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,291,300,129円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	558,678,321円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,195,881,811円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,422,538円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,320,796,928円
世界経済インデックスファンド	14,615,948,557円
D C マイセレクション 2 5	1,949,656,225円
D C マイセレクション 5 0	1,688,400,483円
D C マイセレクション 7 5	1,151,498,112円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,303,371,544円
D C マイセレクション S 2 5	960,204,963円
D C マイセレクション S 5 0	762,778,120円
D C マイセレクション S 7 5	432,050,826円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	25,192,171円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	91,875,201円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	47,644,201円
D C 世界経済インデックスファンド	13,053,032,035円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	599,636,890円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,727,388円
マイセレクション 7 5 V A 1（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 V A 1（適格機関投資家専用）	21,643,631円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	41,756,194円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	68,363,691円



区分	2022年 8月29日現在
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	73,376,503円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	67,730,491円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,208,142,631円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	422,938,457円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,695,784,232円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	68,548,875円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	37,357,331円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	422,511,901円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	162,296,603円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	206,607,175円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	735,049,745円
グローバル債券ファンド・シリーズ 1（適格機関投資家専用）	2,744,514,685円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	688,811,698円
外国債券ファンド・シリーズ 1	700,789,295円
コア投資戦略ファンド（安定型）	511,218,449円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,348,562,464円
分散投資コア戦略ファンド A	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンド S	556,972,964円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	568,367,383円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,155,426,751円
コア投資戦略ファンド（切替型）	617,085,545円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	252,004,718円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	109,077,493円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,359,309,029円
S M T インデックスバランス・オープン	197,880,957円
外国債券 S M T B セレクション（S M A 専用）	15,548,998,921円
S M T 世界経済インデックス・オープン	268,450,078円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	336,649,074円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	535,909,769円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	5,445,781円
グローバル経済コア	861,852,157円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	17,263,138円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	1,747,051円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	199,453,093円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,400,351円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 3 0	17,693,076円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 4 0	19,468,895円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 5 0	8,351,944円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 6 0	13,104,542円
M y S M T グローバル債券インデックス（ノーロード）	23,836,662円
1 0 資産分散投資ファンド	7,886円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンド S（適格機関投資家専用）	260,145,149円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンド P（適格機関投資家専用）	11,030,504,775円

区分	2022年 8月29日現在
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	331,579,538円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	301,479,729円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	360,230,834円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	997,961,657円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	89,594,351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）	73,315,485円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 8月29日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		9,258,095,615
合計		9,258,095,615

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2022年 8月29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	4,318,669,263		-	4,276,124,835	42,544,428
	合計	4,318,669,263		-	4,276,124,835	42,544,428

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2022年 8月29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	4,373,499,569		-	4,416,136,444	42,636,875

	アメリカドル	2,465,672,107	-	2,511,930,600	46,258,493
	カナダドル	183,491,343	-	185,038,875	1,547,532
	ユーロ	1,485,438,608	-	1,481,878,099	3,560,509
	イギリスポンド	238,897,511	-	237,288,870	1,608,641
	合計	4,373,499,569	-	4,416,136,444	42,636,875

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,564,062.50	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,493,174.39	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,857,031.25	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,798,207.41	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,716,562.48	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,117,651.35	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,391,640.69	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,482,812.50	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,512,910.19	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,478,929.67	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,746,828.11	
		T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,609,765.64	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,816,210.97	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,262,781.26	
		T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,599,316.42	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,228,437.52	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,668,320.33	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,386,250.00	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,521,840.99	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,794,453.12	

T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,716,796.90	
T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,210,187.50	
T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	6,932,812.48	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,723,320.32	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,622,343.76	
T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,075,664.08	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,705,575.00	
T 0.5% 04/30/27	11,940,000.00	10,524,457.00	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,079,316.41	
T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,110,934.35	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,076,953.89	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,530,859.37	
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,665,917.95	
T 0.625% 05/15/30	12,000,000.00	10,005,000.00	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,207,812.48	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,912,898.43	
T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,795,043.75	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,186,523.45	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	8,728,125.00	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,457,753.88	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,033,632.84	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,731,406.25	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,635,000.00	
T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,695,059.37	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,253,367.24	
T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,254,156.25	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,293,437.52	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,445,234.36	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,424,363.33	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,449,109.39	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,950,054.68	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,040,800.76	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,157,812.48	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,183,106.25	
T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	5,007,343.75	
T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,049,809.00	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,630,171.87	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,182,187.52	
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,440,039.06	
T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,171,875.04	
T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	8,505,097.68	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,466,464.86	

T 1.25% 08/15/31	19,380,000.00	16,684,968.75
T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,929,921.87
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,435,078.16
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,545,674.25
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,813,750.00
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,440,414.11
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,452,294.92
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	3,918,359.36
T 1.375% 11/15/31	21,030,000.00	18,220,523.43
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,288,125.00
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,395,835.96
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,563,593.78
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,800,759.37
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,993,457.05
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,182,910.13
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,443,531.27
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,774,609.37
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	7,639,628.88
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,134,598.04
T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,960,957.08
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,134,062.50
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,451,367.20
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,618,546.86
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,800,890.62
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,469,113.29
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,502,656.28
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,330,765.61
T 1.75% 08/15/41	12,330,000.00	9,328,415.62
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,750,625.00
T 1.875% 02/15/32	8,020,000.00	7,251,834.37
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	6,154,593.75
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,895,859.40
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,770,000.00
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,917,727.72
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,827,617.18
T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	6,884,906.25
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,166,289.08
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,581,562.48
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,007,064.43
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,259,082.02
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,090,872.67
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,448,125.00
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,690,687.48

T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,877,148.45
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,639,433.59
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,937,968.76
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,565,779.27
T 2.25% 02/15/52	2,300,000.00	1,867,312.50
T 2.25% 03/31/24	5,900,000.00	5,796,404.31
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,225,488.30
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,872,714.87
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,357,762.50
T 2.25% 08/15/27	3,030,000.00	2,893,294.91
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,335,305.48
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,479,492.21
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,152,589.82
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,909,730.51
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,247,031.27
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,289,314.43
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,433,818.36
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,262,890.65
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,638,046.87
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,675,962.52
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,661,125.00
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,515,906.25
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,237,925.83
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,620,764.06
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	6,816,074.24
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,907,128.90
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	3,433,109.37
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,427,438.29
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,897,265.65
T 2.5% 02/15/45	1,710,000.00	1,437,201.56
T 2.5% 02/15/46	6,450,000.00	5,404,394.56
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,786,591.78
T 2.5% 05/15/46	3,450,000.00	2,889,644.54
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,515,697.27
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,579,345.31
T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,900,196.87
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,114,628.94
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,466,982.43
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,684,957.84
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,973,281.25
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,389,064.46
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,549,484.37

T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,405,468.75
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	996,015.63
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,161,976.56
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,574,441.42
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,491,884.76
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,773,589.86
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,303,053.11
T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	3,496,762.50
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,696,390.62
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,945,625.00
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,122,173.47
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,763,207.05
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	5,145,287.50
T 2.875% 05/15/52	1,800,000.00	1,684,265.63
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,767,176.58
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,382,152.35
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,845,121.88
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,066,765.62
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,729,404.28
T 2.875% 10/31/23	7,900,000.00	7,858,185.53
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,250,781.25
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	3,996,131.25
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,384,570.35
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,185,710.97
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,843,750.00
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,093,232.06
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,232,745.12
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,366,474.63
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,619,513.68
T 2% 08/15/51	17,350,000.00	13,245,640.62
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,695,027.31
T 2% 11/15/41	8,200,000.00	6,485,687.50
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,002,914.06
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,890,468.76
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,667,319.56
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	3,889,982.83
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,358,656.29
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,674,394.54
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,949,800.00
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,330,226.58
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	800,980.47
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,445,562.51
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,042,343.76

T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,096,875.00	
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,120,234.39	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,558,863.28	
T 3% 02/15/47	800,000.00	737,187.50	
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	4,138,847.67	
T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,722,265.65	
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,514,320.32	
T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,295,507.82	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,961,475.79	
T 3% 08/15/48	7,250,000.00	6,781,015.62	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,153,898.44	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,943,359.40	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,572,281.26	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,024,945.31	
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,651,093.75	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,157,031.25	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,185,742.19	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,231,531.25	
T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,415,331.26	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,272,745.31	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	644,531.25	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,992,851.57	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,640,151.56	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	901,933.59	
T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,351,710.94	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,447,824.22	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,280,890.62	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,844,964.84	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,647,166.01	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,275,503.91	
T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,697,211.91	
アメリカドル 小計	1,273,310,000.00	1,168,852,521.31 (161,699,057,798)	
カナダドル			
CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,049,104.40	
CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,279,400.00	
CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,318,003.20	
CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,274,656.00	
CAN 0.5% 12/01/30	4,940,000.00	4,027,582.00	
CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,249,248.00	
CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	661,703.00	
CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,363,723.20	
CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,739,275.60	



	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,176,912.00	
	CAN 1.5% 04/01/25	2,710,000.00	2,578,537.90	
	CAN 1.5% 05/01/24	1,590,000.00	1,537,243.80	
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,275,897.60	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,503,564.70	
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,154,040.00	
	CAN 1.5% 12/01/31	4,320,000.00	3,788,899.20	
	CAN 1.75% 12/01/53	2,260,000.00	1,698,435.20	
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	733,552.20	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,401,587.10	
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,256,369.00	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,241,536.00	
	CAN 2.25% 06/01/29	760,000.00	723,626.40	
	CAN 2.25% 12/01/29	510,000.00	484,224.60	
	CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,307,323.50	
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	827,786.40	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,650,000.00	1,578,786.00	
	CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	716,915.60	
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,234,321.30	
	CAN 2% 06/01/32	1,290,000.00	1,179,150.30	
	CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,402,529.40	
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,808,270.50	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,134,189.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,192,674.00	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,020,000.00	1,187,239.20	
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,193,126.40	
	CAN 5% 06/01/37	880,000.00	1,081,740.00	
	カナダドル 小計	68,410,000.00	63,361,172.70 (6,709,314,577)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,324,031.50	
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,895,548.80	
	MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	10,887,000.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	52,610,000.00	47,285,868.00	
	MBONO 5% 03/06/25	5,200,000.00	4,697,576.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	36,672,285.90	
	MBONO 7.75% 05/29/31	42,690,000.00	39,715,787.70	
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	25,328,433.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	8,110,228.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	37,340,000.00	36,572,663.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	25,576,263.30	
	MBONO 8% 07/31/53	3,700,000.00	3,373,919.00	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,503,116.50	
	MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	25,811,908.00	

	MBONO 8% 12/07/23	29,070,000.00	28,405,169.10
	メキシコペソ 小計	388,130,000.00	366,159,798.30 (2,523,829,641)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,207,709.80
	BGB 0.2% 10/22/23	630,000.00	625,218.30
	BGB 0.35% 06/22/32	1,330,000.00	1,132,468.40
	BGB 0.4% 06/22/40	1,010,000.00	706,888.90
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,404,195.40
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	308,377.60
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,653,762.80
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,641,159.00
	BGB 0.8% 06/22/28	1,460,000.00	1,402,330.00
	BGB 0.9% 06/22/29	2,430,000.00	2,314,599.30
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	722,943.00
	BGB 0% 10/22/31	1,830,000.00	1,539,707.10
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,394,280.00
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	781,882.50
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	707,624.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	1,024,103.60
	BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,075,906.00
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	981,330.00
	BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,255,444.40
	BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,931,103.00
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	786,086.40
	BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	709,816.80
	BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,202,659.20
	BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,443,468.00
	BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,112,915.00
	BGB 4.25% 03/28/41	2,030,000.00	2,538,819.50
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,268,854.20
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,278,126.00
	BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,381,786.60
	BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	2,974,801.60
	BKO 0.2% 06/14/24	500,000.00	494,160.00
	BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,829,206.00
	BKO 0% 09/15/23	2,470,000.00	2,454,439.00
	BKO 0% 12/15/23	1,880,000.00	1,864,057.60
	BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,450,646.40
	BTPS 0.3% 08/15/23	1,270,000.00	1,258,328.70
	BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	556,272.20
	BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,751,323.50
	BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,789,593.60

BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	1,976,395.20
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,469,666.40
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	664,981.70
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,085,547.50
BTPS 0.9% 04/01/31	3,830,000.00	3,111,836.70
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	709,073.40
BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	2,006,952.00
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,861,135.70
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,176,343.40
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,710,844.40
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	978,410.00
BTPS 0% 01/30/24	1,630,000.00	1,594,971.30
BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,526,997.80
BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	2,919,240.00
BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,334,977.40
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,445,550.00
BTPS 0% 11/29/23	1,750,000.00	1,717,800.00
BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,766,803.00
BTPS 1.1% 04/01/27	1,000,000.00	929,510.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,847,469.00
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,693,523.00
BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,313,913.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,250,228.00
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,371,872.00
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	823,987.50
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,364,740.20
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,741,619.10
BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,790,229.00
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,228,596.00
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,089,009.60
BTPS 1.75% 05/30/24	800,000.00	797,864.00
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	998,510.00
BTPS 1.8% 03/01/41	2,260,000.00	1,669,733.20
BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,452,744.00
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,666,520.00
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,650,210.20
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,150,432.00
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	487,997.70
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	719,293.80
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,226,420.00
BTPS 2.25% 09/01/36	2,850,000.00	2,407,366.50
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,358,417.60
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,394,007.70

BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	2,945,705.70
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	2,961,151.00
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,982,273.00
BTPS 2.65% 12/01/27	960,000.00	946,569.60
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	1,836,974.10
BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	895,830.10
BTPS 2.8% 06/15/29	820,000.00	801,492.60
BTPS 2.8% 12/01/28	2,720,000.00	2,691,956.80
BTPS 2.95% 09/01/38	1,580,000.00	1,429,710.40
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,164,040.40
BTPS 2% 12/01/25	1,490,000.00	1,473,922.90
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,297,312.00
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	898,876.80
BTPS 3.25% 09/01/46	1,970,000.00	1,811,572.60
BTPS 3.35% 03/01/35	1,820,000.00	1,754,407.20
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,000,304.80
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,043,952.00
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,227,679.50
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	1,861,971.60
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,152,943.80
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,866,215.00
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,228,886.40
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,766,508.00
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,883,111.20
BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,395,092.00
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,675,741.00
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,465,390.00
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,055,658.80
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,698,152.00
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,920,958.00
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,347,694.90
BTPS 5% 09/01/40	2,240,000.00	2,590,537.60
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,258,944.00
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	3,520,679.40
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,666,630.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	870,168.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,755,133.70
DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	2,903,793.20
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,490,715.20
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,049,015.20
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,949,480.00
DBR 0.5% 02/15/28	3,680,000.00	3,552,414.40

DBR 0.5% 08/15/27	2,930,000.00	2,846,700.10
DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,259,778.30
DBR 0% 02/15/31	3,280,000.00	2,952,623.20
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	3,230,206.20
DBR 0% 05/15/35	2,780,000.00	2,306,871.80
DBR 0% 05/15/36	3,130,000.00	2,551,889.00
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,177,087.50
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,223,675.00
DBR 0% 08/15/30	3,830,000.00	3,474,920.70
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	608,165.70
DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,899,219.90
DBR 0% 08/15/50	5,330,000.00	3,511,830.40
DBR 0% 08/15/52	1,790,000.00	1,142,485.40
DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	2,790,540.00
DBR 0% 11/15/28	1,720,000.00	1,600,167.60
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,392,622.80
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,318,029.60
DBR 1.7% 08/15/32	350,000.00	360,108.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,675,360.50
DBR 1% 05/15/38	800,000.00	739,312.00
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,004,540.00
DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,643,712.80
DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	3,981,297.60
DBR 2.5% 08/15/46	3,610,000.00	4,343,876.90
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	2,898,810.20
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,899,691.30
DBR 4.0% 01/04/37	3,190,000.00	4,209,651.60
DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	3,009,161.50
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,061,708.50
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,088,735.30
DBR 4.75% 07/04/40	2,260,000.00	3,385,706.00
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,798,074.00
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,901,077.20
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,470,021.30
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,693,087.50
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,225,548.80
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,462,614.00
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,485,411.10
FRTR 0.5% 05/25/26	6,690,000.00	6,490,704.90
FRTR 0.5% 05/25/29	5,950,000.00	5,531,239.00
FRTR 0.5% 05/25/40	3,210,000.00	2,356,396.80
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	451,638.00
FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,342,044.00

FRTR 0.75% 02/25/28	2,150,000.00	2,058,001.50	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,019,089.70	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,980,000.00	2,563,438.40	
FRTR 0.75% 05/25/53	2,660,000.00	1,673,485.80	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,566,041.00	
FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,794,031.00	
FRTR 0% 02/25/25	2,050,000.00	1,989,730.00	
FRTR 0% 02/25/26	4,460,000.00	4,266,346.80	
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,278,146.40	
FRTR 0% 03/25/24	4,260,000.00	4,205,344.20	
FRTR 0% 03/25/25	5,490,000.00	5,324,751.00	
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,725,089.60	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	4,671,774.20	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,228,405.20	
FRTR 0% 11/25/31	5,790,000.00	4,893,244.80	
FRTR 1.25% 05/25/34	4,390,000.00	3,983,354.30	
FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	4,535,484.30	
FRTR 1.5% 05/25/31	6,170,000.00	6,043,576.70	
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	2,916,480.10	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	1,443,366.40	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,320,000.00	3,083,881.60	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,219,779.20	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,556,488.50	
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,240,505.60	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,193,275.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	7,180,000.00	7,623,221.40	
FRTR 2.75% 10/25/27	6,580,000.00	6,997,303.60	
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,264,626.80	
FRTR 2% 11/25/32	580,000.00	579,205.40	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,400,000.00	3,887,526.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,600,000.00	6,040,440.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	5,878,373.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	5,958,264.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,540,000.00	4,550,280.60	
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,218,842.00	
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,761,327.80	
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	4,140,213.50	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	6,432,152.10	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,855,137.40	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,179,813.00	
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	877,334.10	
IRISH 0.2% 10/18/30	960,000.00	844,291.20	

IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	398,860.80
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	489,945.90
IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	362,680.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	741,109.60
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	714,000.00
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,156,416.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	620,560.70
IRISH 1.35% 03/18/31	790,000.00	762,926.70
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	642,528.00
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	764,912.40
IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,623,140.80
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,272,060.90
IRISH 2% 02/18/45	1,280,000.00	1,187,481.60
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,005,860.90
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,282,275.60
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,251,695.60
NETHER 0.25% 07/15/29	1,570,000.00	1,443,709.20
NETHER 0.5% 01/15/40	1,780,000.00	1,420,867.20
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,255,666.40
NETHER 0.5% 07/15/32	900,000.00	801,225.00
NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,516,819.20
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,635,859.00
NETHER 0% 01/15/24	1,630,000.00	1,611,026.80
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,141,876.40
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,737,309.60
NETHER 0% 01/15/29	1,390,000.00	1,263,551.70
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	719,308.80
NETHER 0% 01/15/52	1,610,000.00	937,342.00
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,198,881.00
NETHER 0% 07/15/31	1,770,000.00	1,540,254.00
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,164,490.60
NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,742,992.50
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,029,720.40
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	2,924,505.00
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,756,479.20
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,096,189.10
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,291,272.10
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,961,229.90
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,659,962.50
OBL 0% 04/16/27	1,100,000.00	1,045,715.00
OBL 0% 10/09/26	3,900,000.00	3,729,804.00
OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,396,015.00
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,499,611.20

OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,363,728.00	
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	459,612.00	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,810,000.00	1,679,390.40	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,045,746.00	
RAGB 0.7% 04/20/71	440,000.00	237,679.20	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,156,554.30	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	536,749.20	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,031,972.80	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	155,505.90	
RAGB 0.9% 02/20/32	880,000.00	796,329.60	
RAGB 0% 02/20/30	1,690,000.00	1,480,693.50	
RAGB 0% 02/20/31	1,640,000.00	1,400,215.60	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	900,453.90	
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,411,804.80	
RAGB 0% 10/20/28	200,000.00	180,346.00	
RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	444,719.20	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,069,443.60	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	894,235.70	
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	195,048.00	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,001,196.90	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,343,885.20	
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	423,241.40	
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	705,639.60	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,114,290.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	965,746.50	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	574,387.80	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,257,309.60	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,540,688.30	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,450,798.20	
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	337,554.80	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	260,999.40	
RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	463,752.00	
RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	355,010.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	603,408.80	
RFGB 0.5% 04/15/43	440,000.00	314,380.00	
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	829,466.70	
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	609,693.50	
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	701,525.60	
RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	734,488.00	
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	683,424.30	
RFGB 0% 09/15/23	570,000.00	565,417.20	
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	411,226.20	



RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	283,818.00
RFGB 0% 09/15/30	520,000.00	452,244.00
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	506,671.20
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	421,473.50
RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	470,037.40
RFGB 2.625% 07/04/42	680,000.00	720,487.20
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	587,400.00
RFGB 2% 04/15/24	660,000.00	672,540.00
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	897,470.70
SPGB 0.1% 04/30/31	2,700,000.00	2,230,200.00
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,245,619.80
SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	3,001,282.00
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,169,773.90
SPGB 0.6% 10/31/29	2,050,000.00	1,844,897.50
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,864,126.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,323,514.40
SPGB 0.8% 07/30/29	740,000.00	677,277.60
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,100,694.00
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,205,580.80
SPGB 0% 01/31/26	2,720,000.00	2,572,984.00
SPGB 0% 01/31/27	1,560,000.00	1,442,064.00
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,741,612.70
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,068,601.80
SPGB 0% 05/31/25	990,000.00	948,697.20
SPGB 1.2% 10/31/40	2,810,000.00	2,113,878.70
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	2,823,995.00
SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,190,712.50
SPGB 1.4% 04/30/28	3,070,000.00	2,987,662.60
SPGB 1.4% 07/30/28	3,030,000.00	2,936,463.90
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,590,792.80
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	2,981,115.20
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	364,518.00
SPGB 1.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,976,440.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,065,555.00
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	2,488,447.50
SPGB 1.9% 10/31/52	900,000.00	677,700.00
SPGB 1.95% 04/30/26	3,600,000.00	3,640,572.00
SPGB 1.95% 07/30/30	2,740,000.00	2,687,200.20
SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	629,861.90
SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	1,516,357.70
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,871,117.50
SPGB 2.35% 07/30/33	2,150,000.00	2,105,129.50
SPGB 2.55% 10/31/32	1,350,000.00	1,345,680.00

	SPGB 2.7% 10/31/48	2,160,000.00	2,030,292.00	
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,146,898.50	
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,161,720.00	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,819,605.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,631,283.20	
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	2,957,367.60	
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,794,910.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,103,523.60	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,240,000.00	2,818,592.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,840,000.00	1,936,195.20	
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,030,000.00	2,600,490.90	
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	4,127,343.80	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,353,402.20	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,698,552.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,396,933.60	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,303,837.50	
	ユーロ 小計	779,510,000.00	766,694,613.30 (105,313,172,082)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,397,366.40	
	UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,171,531.00	
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	1,989,206.80	
	UKT 0.25% 01/31/25	1,800,000.00	1,690,398.00	
	UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,663,022.60	
	UKT 0.375% 10/22/26	2,970,000.00	2,706,739.20	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,813,030.50	
	UKT 0.5% 01/31/29	1,650,000.00	1,448,832.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	641,230.20	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,609,934.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	2,810,000.00	2,113,513.40	
	UKT 0.625% 10/22/50	880,000.00	502,013.60	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	758,897.10	
	UKT 0.875% 07/31/33	1,260,000.00	1,038,819.60	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,521,075.00	
	UKT 1.125% 01/31/39	1,370,000.00	1,039,391.60	
	UKT 1.125% 10/22/73	520,000.00	304,636.80	
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	893,114.00	
	UKT 1.25% 07/31/51	1,710,000.00	1,168,083.90	
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,095,408.00	
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,534,592.00	
	UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,772,499.30	
	UKT 1.5% 07/31/53	420,000.00	304,386.60	
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	1,017,826.80		

	UKT 1.625% 10/22/54	1,740,000.00	1,299,292.80	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	1,069,492.40	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,022,970.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	1,716,573.30	
	UKT 1.75% 09/07/37	2,190,000.00	1,868,573.70	
	UKT 1% 01/31/32	1,720,000.00	1,483,930.00	
	UKT 1% 04/22/24	800,000.00	777,056.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,486,575.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	2,000,000.00	1,920,120.00	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,690,540.80	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,747,657.40	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,230,000.00	2,315,810.40	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	2,474,161.80	
	UKT 3.5% 07/22/68	2,130,000.00	2,592,976.80	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	1,883,648.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	1,884,638.80	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,397,780.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	1,891,463.40	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,479,093.10	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,060,817.50	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	2,335,776.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,880,236.90	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,502,462.90	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,570,000.00	1,839,553.30	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,050,000.00	2,516,867.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,704,126.60	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,034,994.50	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	1,992,251.80	
	UKT 5% 03/07/25	2,300,000.00	2,424,752.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,499,475.00	
	イギリスボンド 小計	95,890,000.00	91,989,215.60 (14,863,617,456)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,556,694.80	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	6,000,476.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	6,966,918.00	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,424,750.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,640,000.00	9,213,526.40	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,495,941.00	
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	9,361,101.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	6,577,019.10	
	スウェーデンクローナ 小計	62,510,000.00	61,596,426.30 (795,209,863)	
	NGB 1.25% 09/17/31	4,340,000.00	3,652,196.80	

ノルウェークローネ	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,626,713.60	
	NGB 1.5% 02/19/26	6,470,000.00	6,066,336.70	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,949,043.40	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,070,000.00	5,824,043.60	
	NGB 1.75% 09/06/29	6,010,000.00	5,433,520.80	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,220,000.00	2,908,754.80	
	NGB 2% 04/26/28	5,020,000.00	4,681,903.00	
	NGB 3% 03/14/24	7,760,000.00	7,716,854.40	
ノルウェークローネ 小計		49,600,000.00	45,859,367.10	(647,534,263)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,880,000.00	3,772,137.60	
	DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	8,399,358.00	
	DGB 0.5% 11/15/29	8,280,000.00	7,646,911.20	
	DGB 0% 11/15/24	2,870,000.00	2,792,395.20	
	DGB 0% 11/15/31	8,390,000.00	7,151,048.70	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,550,000.00	7,595,602.00	
	DGB 1.75% 11/15/25	5,510,000.00	5,582,732.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	13,320,000.00	18,379,069.20	
デンマーククローネ 小計		60,650,000.00	61,319,253.90	(1,132,566,619)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,290,000.00	1,766,941.10	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,053,127.20	
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,891,598.40	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,872,630.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	1,610,000.00	1,098,164.90	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,565,296.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,550,000.00	3,317,439.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,650,000.00	6,557,197.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,260,000.00	3,540,826.80	
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,750,000.00	4,772,615.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	4,984,459.20	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,451,111.40	
	POLGB 3.75% 05/25/27	530,000.00	467,104.90	
	POLGB 4% 10/25/23	2,410,000.00	2,338,278.40	
POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	582,552.00		
ポーランドズロチ 小計		53,580,000.00	45,259,342.30	(1,309,913,988)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	3,430,000.00	3,219,569.50	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,905,645.00	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,660,000.00	2,375,646.00	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,219,811.00	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	2,695,518.10	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,244,665.70	

	ACGB 1.75% 11/21/32	2,400,000.00	2,024,664.00	
	ACGB 1% 11/21/31	3,610,000.00	2,882,765.50	
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,929,536.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,390,978.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,620,000.00	3,374,310.60	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,374,328.20	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,376,730.60	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,079,676.00	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,870,884.10	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,596,372.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,343,433.90	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,560,588.80	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,172,786.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,035,540.80	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,609,291.80	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,438,819.20	
	ACGB 3% 11/21/33	1,290,000.00	1,213,554.60	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,130,000.00	2,198,202.60	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,490,087.60	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,457,924.00	
	オーストラリアドル 小計	56,000,000.00	51,081,329.80 (4,849,150,637)	
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	700,755.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	530,000.00	499,922.50	
	SIGB 1.625% 07/01/31	650,000.00	585,084.50	
	SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	634,116.60	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	249,120.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,059,868.80	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	816,414.80	
	SIGB 2.375% 06/01/25	940,000.00	933,269.60	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	394,899.10	
	SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	604,906.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	720,335.60	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	601,064.10	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	651,196.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	1,070,000.00	1,069,989.30	
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	673,526.40	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	864,685.70	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	763,761.40	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,600,350.90	
	シンガポールドドル 小計	13,960,000.00	13,423,266.80 (1,327,963,784)	

マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,510,000.00	1,366,459.40	
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,927,507.20	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,497,920.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,597,411.20	
	MGS 3.757% 05/22/40	1,830,000.00	1,686,582.90	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	939,058.20	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,715,501.70	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,636,516.50	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,389,988.30	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,498,605.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,139,424.20	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,989,837.90	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,120,000.00	2,144,486.00	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	606,660.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,171,698.40	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,300,275.20	
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,159,305.20	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,301,798.40	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,541,866.70	
	MGS 4.254% 05/31/35	2,760,000.00	2,763,615.60	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,571,650.00	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	2,963,846.60	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,846,711.80	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,094,604.00	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,525,095.60	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,413,174.80	
MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,453,959.20		
MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,774,231.20		
MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,095,137.20		
マレーシアリンギット 小計		53,680,000.00	54,112,928.40 (1,670,168,478)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	840,000.00	823,721.47	
	ILGOV 0.4% 10/31/24	1,010,000.00	962,974.80	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,047,449.87	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,289,147.69	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	590,000.00	515,946.02	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,970,000.00	1,608,921.45	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	2,230,000.00	2,207,637.33	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,208,002.91	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,494,370.49	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,010,000.00	1,954,750.32	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,664,574.00	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,154,526.50	

	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,334,721.71	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,837,663.10	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	2,660,000.00	3,024,892.68	
	イスラエルシェケル 小計	31,020,000.00	31,129,300.34 (1,308,408,074)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	29,520,000.00	29,337,566.40	
	CGB 2.18% 06/25/24	22,500,000.00	22,537,575.00	
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,735,502.00	
	CGB 2.47% 09/02/24	18,980,000.00	19,111,531.40	
	CGB 2.48% 04/15/27	9,000,000.00	9,016,920.00	
	CGB 2.56% 10/21/23	30,440,000.00	30,655,819.60	
	CGB 2.68% 05/21/30	22,480,000.00	22,467,860.80	
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,435,501.60	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,000,000.00	10,079,200.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,334,341.60	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,797,722.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	21,430,000.00	21,819,168.80	
	CGB 2.89% 11/18/31	9,510,000.00	9,630,586.80	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,790,000.00	6,913,238.50	
	CGB 3.01% 05/13/28	10,930,000.00	11,203,140.70	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,201,884.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	47,921,050.80	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,151,331.50	
	CGB 3.28% 12/03/27	19,110,000.00	19,893,701.10	
	CGB 3.39% 03/16/50	10,420,000.00	10,795,224.20	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	7,976,417.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	2,390,000.00	2,627,374.80	
	CGB 3.81% 09/14/50	7,460,000.00	8,311,335.20	
CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,420,954.40		
CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,758,270.30		
	オフショア人民元 小計	391,470,000.00	400,133,218.50 (8,007,225,888)	
	合計		312,157,133,148 (312,157,133,148)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 221銘柄	100.0%	51.8%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 353銘柄	100.0%	33.7%
イギリスポンド	国債証券 54銘柄	100.0%	4.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券 25銘柄	100.0%	2.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2022年 8月29日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	390,991,857
コール・ローン	1,435,774,546
国債証券	83,241,935,331
未収利息	1,218,543,906
前払費用	110,993,688
流動資産合計	86,398,239,328
資産合計	86,398,239,328
負債の部	
流動負債	
未払解約金	17,047,242
未払利息	2,402
流動負債合計	17,049,644
負債合計	17,049,644



	2022年 8月29日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	47,776,566,303
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	38,604,623,381
元本等合計	86,381,189,684
純資産合計	86,381,189,684
負債純資産合計	86,398,239,328

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 8月29日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 8月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,776,566,303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 1.8080円 (1万口当たり純資産額) (18,080円)

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	2022年 8月29日現在
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 8月29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 8月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月31日
期首元本額	43,075,152,206円
期中追加設定元本額	9,844,003,144円
期中一部解約元本額	5,142,589,047円
期末元本額	47,776,566,303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	5,271,824,631円
世界経済インデックスファンド	12,907,838,201円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,146,203,089円
DC世界経済インデックスファンド	11,167,288,575円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	4,009,311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）	54,725,851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）	474,394,008円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,556,192,946円
コア投資戦略ファンド（切替型）	125,149,470円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	208,595,762円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	94,074,925円
SMT インデックスバランス・オープン	169,397,798円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,080,750,418円
SMT 世界経済インデックス・オープン	351,693,660円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	440,088,438円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	700,338,592円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,723,762円
グローバル経済コア	752,788,285円

区分	2022年 8月29日現在
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	30,863,900円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	23,534,761円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	8,498,619円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	11,692,657円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	2,046,201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）	58,041,477円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	482,978,376円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	117,340,061円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	14,773,787円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	282,637,302円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	277,843,492円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	276,426,997円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	273,775,150円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	269,515,561円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 8月29日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,813,029,916
合計	4,813,029,916

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	34,678,854.00	
		MBONO 10% 12/05/24	104,250,000.00	105,394,665.00	
		MBONO 5.5% 03/04/27	17,000,000.00	14,806,320.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	198,300,000.00	178,232,040.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	54,100,000.00	53,293,369.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	114,000,000.00	107,443,860.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	140,600,000.00	130,804,398.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	74,807,850.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	34,600,000.00	31,707,786.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	115,100,000.00	112,734,695.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	94,268,717.00	
		MBONO 8% 07/31/53	6,500,000.00	5,927,155.00	
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	124,798,380.00	
		MBONO 8% 11/07/47	100,600,000.00	91,432,322.00	
		MBONO 8% 12/07/23	88,000,000.00	85,987,440.00	
メキシコペソ 小計			1,316,050,000.00	1,246,317,851.00 (8,590,495,051)	
ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/24	138,400,000.00	117,424,954.08		
	BLTN 0% 07/01/23	53,300,000.00	47,892,331.24		
	BLTN 0% 07/01/24	30,850,000.00	24,858,356.19		
	BLTN 0% 07/01/25	38,900,000.00	28,262,756.10		
	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	30,516,606.47		
	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000.00	38,610,708.25		
	BNTNF 10% 01/01/29	31,700,000.00	28,886,676.13		
	BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	12,372,523.73		
	BNTNF 10% 01/01/33	1,500,000.00	1,314,442.06		
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,325,625.00		
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,788,375.00		
	ブラジルリアル 小計			384,800,000.00	333,253,354.25 (9,101,282,405)
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	805,000,000.00	625,797,295.72		
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,855,000,000.00	2,510,866,122.70		
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,920,000,000.00	1,734,787,069.44		
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,170,000,000.00	1,911,039,037.67		
	BTPCL 4% 03/01/23	1,010,000,000.00	982,168,827.84		
	BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	1,909,872,010.80		
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	600,383,556.30		
	BTPCL 6% 01/01/43	1,730,000,000.00	1,612,016,370.10		
チリペソ 小計			13,360,000,000.00	11,886,930,290.57 (1,840,655,494)	
	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	58,287,433,000.00		

コロンビア ペソ	COLTES 6.25% 11/26/25	15,900,000,000.00	13,824,573,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	37,100,000,000.00	26,230,442,000.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	20,900,000,000.00	12,798,115,000.00	
コロンビアペソ 小計		139,200,000,000.00	111,140,563,000.00	(3,491,591,927)
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,333,600.00	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	5,086,540.50	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,657,635.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	9,500,000.00	8,657,065.00	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	7,800,000.00	6,864,624.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,350,000.00	7,865,366.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	7,750,000.00	6,943,922.50	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	9,150,000.00	8,640,253.50	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,050,000.00	6,328,723.50	
ペルーソル 小計		63,150,000.00	57,377,730.00	(2,066,780,261)
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	21,298,250.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	15,365,960.00	
ウルグアイペソ 小計		42,000,000.00	36,664,210.00	(125,574,919)
ドミニカペ ソ	DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	32,548,230.00	
ドミニカペソ 小計		33,000,000.00	32,548,230.00	(84,768,610)
チェココ ルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	18,678,726.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	56,104,592.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	43,835,960.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	64,900,000.00	49,063,102.00	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	21,115,200.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	57,000,000.00	43,095,990.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	52,276,770.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	14,365,014.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	47,000,000.00	36,397,740.00	
	CZGB 1% 06/26/26	54,800,000.00	46,971,272.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	62,700,000.00	57,530,385.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	63,300,000.00	55,497,009.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	80,500,000.00	70,897,155.00	
	CZGB 2% 10/13/33	64,500,000.00	49,646,295.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	19,807,040.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	33,326,310.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	44,855,576.00	
	CZGB 6% 02/26/26	39,500,000.00	40,380,850.00	
	チェココルナ 小計		883,400,000.00	753,844,986.00

			(4,209,847,324)	
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	451,086,240.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	222,500,000.00	205,621,150.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	370,496,340.00	
	HGB 1% 11/26/25	635,000,000.00	475,856,300.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	712,000,000.00	406,317,040.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	139,601,920.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	465,125,960.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	350,456,630.00	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	265,194,150.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	549,033,800.00	
	HGB 3% 04/25/41	321,000,000.00	161,787,210.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	353,459,400.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	378,232,500.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	438,174,720.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	200,073,800.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	580,060,800.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	476,000,000.00	451,505,040.00	
HGB 6.75% 10/22/28	572,000,000.00	506,071,280.00		
ハンガリーフォリント 小計		9,142,000,000.00	6,748,154,280.00	(2,249,369,014)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	14,274,415.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	12,263,966.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	15,200,000.00	10,521,440.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	12,400,000.00	8,457,916.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	16,284,240.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	19,800,000.00	18,502,902.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	20,657,315.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	14,628,768.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	20,600,000.00	17,098,412.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	20,915,496.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	20,350,000.00	18,448,089.00	
	POLGB 3.75% 05/25/27	12,100,000.00	10,664,093.00	
	POLGB 4% 10/25/23	12,700,000.00	12,322,048.00	
ポーランドズロチ 小計		231,700,000.00	195,039,100.00	(5,644,899,647)
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,330,910.00	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	1,200,000.00	1,121,076.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	8,000,000.00	6,809,760.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	12,600,000.00	11,279,898.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	6,000,000.00	4,372,380.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,200,700.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	10,500,000.00	8,787,450.00	

	ROMGB 4.15% 10/24/30	6,400,000.00	4,967,488.00	
	ROMGB 4.25% 06/28/23	11,800,000.00	11,506,180.00	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,086,612.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	3,200,000.00	2,986,240.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	3,800,000.00	2,833,052.00	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,262,195.00	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	1,000,000.00	837,350.00	
	ROMGB 4% 10/25/23	13,800,000.00	13,277,946.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	7,600,000.00	6,961,448.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,112,540.00	
	ルーマニアレイ 小計	111,800,000.00	98,733,225.00 (2,788,364,500)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	23,100,000.00	20,904,114.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,170,136.50	
	MGS 3.48% 03/15/23	14,100,000.00	14,157,951.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	14,650,000.00	14,532,800.00	
	MGS 3.582% 07/15/32	3,500,000.00	3,398,220.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	11,500,000.00	11,428,240.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,881,137.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	18,350,000.00	16,911,910.50	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,169,154.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	7,947,522.00	
	MGS 3.882% 03/14/25	6,100,000.00	6,188,999.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	20,281,121.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	20,800,000.00	21,009,456.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	14,450,000.00	14,616,897.50	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	8,796,570.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	23,000,000.00	23,381,110.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000.00	19,859,672.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	12,450,000.00	11,488,611.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,254,973.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	20,076,265.50	
MGS 4.504% 04/30/29	3,200,000.00	3,325,504.00		
MGS 4.696% 10/15/42	3,500,000.00	3,648,680.00		
MGS 4.762% 04/07/37	9,550,000.00	10,107,815.50		
	マレーシアリンギット 小計	281,250,000.00	278,536,859.50 (8,596,900,900)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	89,321,690.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	139,303,386.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000.00	183,378,080.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	50,815,050.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	55,910,484.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	111,100,000.00	105,998,288.00	



	THAIGB 1% 06/17/27	176,000,000.00	168,007,840.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	113,600,000.00	114,622,400.00	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	123,000,000.00	124,874,520.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	90,100,000.00	81,270,200.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	93,200,000.00	96,944,776.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	64,914,954.00	
	THAIGB 2% 12/17/31	31,000,000.00	29,999,940.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	122,700,000.00	125,643,573.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	134,513,996.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	99,000,000.00	101,038,410.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000.00	192,744,630.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	200,172,600.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	112,370,102.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	138,660,630.00	
	タイバーツ 小計	2,289,500,000.00	2,310,505,549.00 (8,779,921,086)	
フィリピン ペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	29,109,900.00	
	フィリピンペソ 小計	30,000,000.00	29,109,900.00 (71,857,788)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,774,819,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,535,450,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	26,000,000,000.00	24,517,480,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	36,500,000,000.00	35,713,425,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	50,300,000,000.00	50,874,426,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	34,000,000,000.00	32,993,260,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	16,618,080,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	41,000,000,000.00	39,127,530,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	2,100,000,000.00	1,973,790,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	60,534,375,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	26,300,000,000.00	26,776,819,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,428,800,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	28,300,000,000.00	28,277,643,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	35,063,860,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	20,239,583,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	34,700,000,000.00	35,913,806,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	18,965,064,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	40,800,000,000.00	41,406,288,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	43,000,000,000.00	43,126,420,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	46,800,000,000.00	49,017,384,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,200,000,000.00	33,460,128,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	34,508,724,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,394,548,000.00	

	INDOGB 8.375% 03/15/24	53,600,000,000.00	56,098,296,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	48,297,040,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,536,028,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	42,873,316,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	26,205,801,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,177,944,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,781,232,000.00	
	インドネシアルピア 小計	896,100,000,000.00	922,211,359,000.00 (8,668,786,774)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	182,400,000.00	193,650,432.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	54,800,000.00	36,941,228.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	46,100,000.00	29,631,697.00	
	SAGB 7% 02/28/31	64,700,000.00	52,121,673.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	129,000,000.00	110,648,460.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	113,700,000.00	92,904,270.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	116,000,000.00	93,574,880.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	143,200,000.00	115,185,784.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	110,000,000.00	94,927,800.00	
	SAGB 8% 01/31/30	155,100,000.00	137,686,923.00	
	SAGB 9% 01/31/40	100,300,000.00	83,853,809.00	
	南アフリカランド 小計	1,215,300,000.00	1,041,126,956.00 (8,485,184,691)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,515,952.00	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	3,004,740.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	8,000,000.00	8,039,280.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,285,258.00	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,113,400.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,200,000.00	7,218,432.00	
	CGB 2.75% 06/15/29	2,000,000.00	2,015,840.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,132,240.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,848,356.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,734,144.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	17,089,111.00	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,101,440.00	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,108,900.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,400,890.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	15,000,000.00	15,374,850.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,700,600.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	12,900,000.00	13,198,893.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	17,500,000.00	17,934,525.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,592,200.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	15,300,000.00	15,787,458.00	
CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,554,285.00		

	CGB 3.22% 12/06/25	5,600,000.00	5,766,880.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,754,380.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,710,661.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,967,780.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	15,200,000.00	15,823,352.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,832,042.00	
	CGB 3.29% 10/18/23	10,000,000.00	10,169,000.00	
	CGB 3.53% 10/18/51	6,300,000.00	6,745,158.00	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,300,000.00	8,025,036.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	17,500,000.00	19,497,100.00	
	オフショア人民元 小計	410,800,000.00	422,042,183.00 (8,445,654,940)	
	合計		83,241,935,331 (83,241,935,331)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.3%
ブラジルリアル	国債証券 11銘柄	100.0%	10.9%
チリペソ	国債証券 8銘柄	100.0%	2.2%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	4.2%
ペルーソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.5%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%
チェココルナ	国債証券 18銘柄	100.0%	5.1%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	2.7%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	6.8%
ルーマニアレイ	国債証券 17銘柄	100.0%	3.3%
マレーシアリンギット	国債証券 23銘柄	100.0%	10.3%
タイバーツ	国債証券 20銘柄	100.0%	10.5%
フィリピンペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアルピア	国債証券 30銘柄	100.0%	10.4%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	10.2%
オフショア人民元	国債証券 31銘柄	100.0%	10.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

(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8月30日から2023年2月28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。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	8,384,350	13,934,189
親投資信託受益証券	761,957,083	907,484,207
未収入金	776,715	12,761,062
流動資産合計	771,118,148	934,179,458
資産合計	771,118,148	934,179,458
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	492,227	15,655,972
未払受託者報酬	112,082	188,956
未払委託者報酬	896,654	1,417,103
未払利息	14	5
その他未払費用	13,952	23,557
流動負債合計	1,514,929	17,285,593
負債合計	1,514,929	17,285,593
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	623,686,255	763,198,196
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	145,916,964	153,695,669
(分配準備積立金)	12,369,612	11,748,158
元本等合計	769,603,219	916,893,865
純資産合計	769,603,219	916,893,865
負債純資産合計	771,118,148	934,179,458

## （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 8月31日 至 2022年 2月28日	第5期中間計算期間 自 2022年 8月30日 至 2023年 2月28日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	398,807	-
受取利息	9	15
有価証券売買等損益	7,260,604	18,979,682
<b>営業収益合計</b>	<b>6,861,788</b>	<b>18,979,667</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	588	2,611
受託者報酬	48,341	188,956
委託者報酬	435,004	1,417,103
その他費用	5,983	23,557
<b>営業費用合計</b>	<b>489,916</b>	<b>1,632,227</b>
営業利益又は営業損失（ ）	7,351,704	20,611,894
経常利益又は経常損失（ ）	7,351,704	20,611,894
中間純利益又は中間純損失（ ）	7,351,704	20,611,894
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（ ）	52,702	1,096,822
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	33,037,864	145,916,964
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,408,176	35,909,976
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,408,176	35,909,976
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,853,887	8,616,199
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,853,887	8,616,199
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	49,293,151	153,695,669

## ( 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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28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 8月30日から2023年 2月28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 8月29日現在)	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	623,686,255口	763,198,196口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2340円 (12,340円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2014円 (12,014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 2月28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



	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日	第5期中間計算期間 自 2022年 8月30日 至 2023年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	135,117,706円	623,686,255円
期中追加設定元本額	515,248,447円	177,127,309円
期中一部解約元本額	26,679,898円	37,615,368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。

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

(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8月30日から2023年2月28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。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	6,556,225	8,600,290
親投資信託受益証券	529,787,662	686,866,495
未収入金	612,389	-
流動資産合計	536,956,276	695,466,785
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,114,307	488,124
未払受託者報酬	81,013	138,130
未払委託者報酬	649,536	1,035,960
未払利息	10	3
その他未払費用	10,075	17,206
流動負債合計	1,854,941	1,679,423
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	418,694,806	553,843,243
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	116,406,529	139,944,119
(分配準備積立金)	14,789,422	14,475,747
元本等合計	535,101,335	693,787,362
純資産合計	535,101,335	693,787,362
負債純資産合計	536,956,276	695,466,785

## （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 8月31日 至 2022年 2月28日	第5期中間計算期間 自 2022年 8月30日 至 2023年 2月28日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	151,011	-
受取利息	2	13
有価証券売買等損益	3,654,910	9,006,592
<b>営業収益合計</b>	<b>3,503,897</b>	<b>9,006,579</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	311	1,812
受託者報酬	29,100	138,130
委託者報酬	261,840	1,035,960
その他費用	3,571	17,206
<b>営業費用合計</b>	<b>294,822</b>	<b>1,193,108</b>
営業利益又は営業損失（ ）	3,798,719	10,199,687
経常利益又は経常損失（ ）	3,798,719	10,199,687
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,798,719	10,199,687
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（ ）	33,895	365,841
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	22,812,778	116,406,529
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,916,784	36,393,123
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,916,784	36,393,123
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,870,932	3,021,687
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,870,932	3,021,687
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	32,026,016	139,944,119

## ( 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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28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 8月30日から2023年 2月28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 8月29日現在)	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	418,694,806口	553,843,243口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2780円 (12,780円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2527円 (12,527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 2月28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

	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日	第5期中間計算期間 自 2022年 8月30日 至 2023年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	87,264,176円	418,694,806円
期中追加設定元本額	348,173,003円	146,221,586円
期中一部解約元本額	16,742,373円	11,073,149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。

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

(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8月30日から2023年2月28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。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,205,488	3,674,461
親投資信託受益証券	179,969,007	272,186,857
未収入金	1,368,123	-
流動資産合計	183,542,618	275,861,318
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,505,122	523,029
未払受託者報酬	28,763	49,240
未払委託者報酬	230,917	369,209
未払利息	3	1
その他未払費用	3,531	6,096
流動負債合計	1,768,336	947,575
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	137,218,170	210,720,034
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	44,556,112	64,193,709
(分配準備積立金)	6,120,706	5,891,142
元本等合計	181,774,282	274,913,743
純資産合計	181,774,282	274,913,743
負債純資産合計	183,542,618	275,861,318

## （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 8月31日 至 2022年 2月28日	第5期中間計算期間 自 2022年 8月30日 至 2023年 2月28日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	36,949	-
受取利息	1	3
有価証券売買等損益	1,485,165	1,759,517
<b>営業収益合計</b>	<b>1,448,215</b>	<b>1,759,514</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	84	597
受託者報酬	12,904	49,240
委託者報酬	116,012	369,209
その他費用	1,550	6,096
<b>営業費用合計</b>	<b>130,550</b>	<b>425,142</b>
営業利益又は営業損失（ ）	1,578,765	2,184,656
経常利益又は経常損失（ ）	1,578,765	2,184,656
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,578,765	2,184,656
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（ ）	81,427	131,863
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,982,537	44,556,112
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,505,944	23,761,849
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,505,944	23,761,849
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,215,241	2,071,459
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,215,241	2,071,459
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	15,613,048	64,193,709

## ( 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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28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 8月30日から2023年 2月28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 8月29日現在)	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,218,170口	210,720,034口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3247円 (13,247円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3046円 (13,046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 2月28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



	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日	第5期中間計算期間 自 2022年 8月30日 至 2023年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	35,103,038円	137,218,170円
期中追加設定元本額	122,053,912円	79,971,140円
期中一部解約元本額	19,938,780円	6,469,276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。

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

(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8月30日から2023年2月28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。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,119,402	5,150,012
親投資信託受益証券	233,722,733	348,793,490
未収入金	5,959,281	-
流動資産合計	242,801,416	353,943,502
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,433,954	1,173,390
未払受託者報酬	33,368	58,098
未払委託者報酬	268,065	435,617
未払利息	5	1
その他未払費用	4,118	7,198
流動負債合計	6,739,510	1,674,304
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	171,309,984	258,368,200
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	64,751,922	93,900,998
(分配準備積立金)	8,213,486	6,603,318
元本等合計	236,061,906	352,269,198
純資産合計	236,061,906	352,269,198
負債純資産合計	242,801,416	353,943,502

## （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 8月31日 至 2022年 2月28日	第5期中間計算期間 自 2022年 8月30日 至 2023年 2月28日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	3,273	-
受取利息	4	13
有価証券売買等損益	1,281,747	256,034
<b>営業収益合計</b>	<b>1,278,470</b>	<b>256,021</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	149	1,197
受託者報酬	13,575	58,098
委託者報酬	122,108	435,617
その他費用	1,639	7,198
<b>営業費用合計</b>	<b>137,471</b>	<b>502,110</b>
営業利益又は営業損失（ ）	1,415,941	758,131
経常利益又は経常損失（ ）	1,415,941	758,131
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,415,941	758,131
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（ ）	261,620	886,297
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,017,604	64,751,922
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,333,266	44,114,264
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	16,333,266	44,114,264
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,587,221	15,093,354
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,587,221	15,093,354
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	20,086,088	93,900,998

## ( 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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28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 8月30日から2023年 2月28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 8月29日現在)	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	171,309,984口	258,368,200口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3780円 (13,780円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3634円 (13,634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 2月28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

	第5期中間計算期間 (2023年 2月28日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日	第5期中間計算期間 自 2022年 8月30日 至 2023年 2月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	28,842,973円	171,309,984円
期中追加設定元本額	173,520,838円	127,447,207円
期中一部解約元本額	31,053,827円	40,388,991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 2月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	

	2023年 2月28日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	1,323,851,180
株式	514,960,844,070
派生商品評価勘定	41,664,550
未収入金	185,015,137
未収配当金	1,044,344,239
差入委託証拠金	105,585,000
流動資産合計	517,661,304,176
資産合計	517,661,304,176
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,201,050
前受金	40,499,800
未払解約金	84,600,864
未払利息	486
流動負債合計	126,302,200
負債合計	126,302,200
純資産の部	
元本等	
元本	259,061,339,341
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	258,473,662,635
元本等合計	517,535,001,976
純資産合計	517,535,001,976
負債純資産合計	517,661,304,176

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 2月28日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益

	2023年 2月28日現在
	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 2月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	259,061,339,341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 1.9977円 (1万口当たり純資産額) (19,977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 2月28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 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	263,768,603,358円
期中追加設定元本額	9,432,133,679円
期中一部解約元本額	14,139,397,696円
期末元本額	259,061,339,341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）	374,332,106円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,088,917,415円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,292,137円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,876,821,868円
世界経済インデックスファンド	4,342,826,407円
日本株式インデックス・オープン	3,202,005,977円
D C マイセレクション 2 5	6,152,072,605円
D C マイセレクション 5 0	18,908,303,260円
D C マイセレクション 7 5	19,332,416,127円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,095,877,070円
D C マイセレクション S 2 5	3,279,223,328円
D C マイセレクション S 5 0	9,591,926,155円
D C マイセレクション S 7 5	7,545,183,202円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,708,960,953円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	128,638,788円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	651,622,777円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	497,678,038円
D C 世界経済インデックスファンド	3,560,135,936円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,303,820,841円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,110,166円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	16,503,636円
マイセレクション 7 5 V A 1（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 V A 1（適格機関投資家専用）	161,465,572円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	24,344,753円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	90,782,181円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	19,122,061円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	52,587,516円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	739,500,769円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	399,585,181円



区分	2023年 2月28日現在
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,598,830,993円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	37,833,319円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	15,957,958円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	423,855,511円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	243,515,549円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	315,751,560円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	32,370,561円
F O F s用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	537,377,057円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,122,495,375円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,994,024,944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	6,232,800,431円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	511,987,258円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	382,615,858円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,713,694,598円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	207,211,144円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,628,226円
S M T インデックスバランス・オープン	52,061,493円
国内株式S M T Bセクション（S M A専用）	28,528,758,431円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	452,804,007円
S M T 世界経済インデックス・オープン	45,069,791円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	178,360,772円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	30,932,655円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	10,757,539円
グローバル経済コア	209,276,932円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	31,318,914円
M y S M T T O P I Xインデックス（ノーロード）	440,462,356円
D Cターゲット・イヤーフンド2055	25,771,834円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	252,168,418円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	22,103,819円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	19,784,865円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	8,727,172円
D Cターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	12,265,962円
10資産分散投資ファンド	94,534,469円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,187,031,867円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	748,761,308円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	294,321,987円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,341,818円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	566,472,752円
S M T A M日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	44,748,094,654円

区分	2023年 2月28日現在
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,326,244円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	212,514,235円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2023年 2月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,493,150,200	-	2,533,650,000	40,499,800
	合計	2,493,150,200	-	2,533,650,000	40,499,800

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2023年 2月28日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	9,788,362,238
コール・ローン	180,861,070
株式	514,337,653,670
投資信託受益証券	203,972,776
投資証券	11,620,998,779
派生商品評価勘定	240,309,539
未収入金	2,546,922
未収配当金	735,283,115
差入委託証拠金	3,651,467,566
流動資産合計	540,761,455,675
資産合計	540,761,455,675
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	133,174,656
前受金	107,057,868
未払解約金	63,247,155
未払利息	66
流動負債合計	303,479,745
負債合計	303,479,745
<b>純資産の部</b>	
元本等	

	2023年 2月28日現在
項目	金額（円）
元本	122,100,266,091
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	418,357,709,839
元本等合計	540,457,975,930
純資産合計	540,457,975,930
負債純資産合計	540,761,455,675

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 2月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

	2023年 2月28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 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 2月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	122,100,266,091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 4.4263円 (1万口当たり純資産額) (44,263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 2月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(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 2月28日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	127,813,585,667円
期中追加設定元本額	8,095,927,906円
期中一部解約元本額	13,809,247,482円
期末元本額	122,100,266,091円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,856,207,499円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,385,235円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	33,779,575,158円
世界経済インデックスファンド	11,066,951,989円
外国株式インデックス・オープン	904,173,620円
D C マイセレクション 2 5	789,924,048円
D C マイセレクション 5 0	3,665,956,263円
D C マイセレクション 7 5	4,409,316,867円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,307,190,237円
D C マイセレクション S 2 5	413,277,148円
D C マイセレクション S 5 0	1,904,972,657円

区分	2023年 2月28日現在
DCマイセレクションS75	1,711,701,604円
DCターゲット・イヤールファンド2025	28,880,902円
DCターゲット・イヤールファンド2035	146,328,737円
DCターゲット・イヤールファンド2045	111,756,862円
DC世界経済インデックスファンド	9,075,391,901円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,168,601,259円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,091,662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）	25,683,221円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	10,748,557円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	40,288,506円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	8,793,791円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	24,210,006円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	217,118,458円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	155,947,613円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,153,660,398円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	87,268,058円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	22,082,454円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	144,386,303円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	46,252,533円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	923,401,665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）	1,002,534,401円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,173,258,498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）	1,305,047,696円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	975,446,573円
コア投資戦略ファンド（切替型）	533,720,506円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	528,253,251円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,584,964円
SMT インデックスバランス・オープン	132,732,687円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	309,754,828円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	10,845,602,392円
SMT 世界経済インデックス・オープン	221,362,613円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	875,969,154円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	151,917,766円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,772,862円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	568,180,778円
グローバル経済コア	532,379,750円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,925,213円
DCターゲット・イヤールファンド2055	5,787,301円

区分	2023年 2月28日現在
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）	93,594,384円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	57,518,063円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	52,860,101円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	23,246,354円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	32,567,396円
10資産分散投資ファンド	54,291,476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）	226,523,627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）	26,666,204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）	887,039,214円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,445,528,540円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	104,302,835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）	84,694,698円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	80,216,279円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	72,963,843円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	223,103,117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）	217,861,630円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	215,611,827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）	108,805,296円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	136,295,489円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2023年 2月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	14,899,864,461	-	15,006,922,329	107,057,868
合計		14,899,864,461	-	15,006,922,329	107,057,868

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	907,508,400	-	907,585,415	77,015
	アメリカドル	660,961,000	-	661,029,035	68,035
	ユーロ	144,577,000	-	144,586,400	9,400
	スイスフラン	101,970,400	-	101,969,980	420
合計		907,508,400	-	907,585,415	77,015

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2023年 2月28日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,977,627,037
コール・ローン	71,953,910
株式	123,170,626,885
投資信託受益証券	323,951,885
投資証券	125,161,884
派生商品評価勘定	5,068,938
未収配当金	215,167,076
前払金	193,312,532
差入委託証拠金	976,938,421
流動資産合計	127,059,808,568
資産合計	127,059,808,568
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	198,390,145
未払金	3,568,110
未払解約金	15,508,239
未払利息	26
流動負債合計	217,466,520
負債合計	217,466,520
純資産の部	
元本等	
元本	36,099,090,564
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	90,743,251,484
元本等合計	126,842,342,048



	2023年 2月28日現在
項目	金額（円）
純資産合計	126,842,342,048
負債純資産合計	127,059,808,568

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 2月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

	2023年 2月28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 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 2月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	36,099,090,564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 3.5137円 (1万口当たり純資産額) (35,137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 2月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(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 2月28日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	31,545,220,148円
期中追加設定元本額	5,309,360,266円
期中一部解約元本額	755,489,850円
期末元本額	36,099,090,564円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,809,745,259円
世界経済インデックスファンド	8,319,784,035円
DC新興国株式インデックス・オープン	5,728,330,043円
DC世界経済インデックスファンド	6,818,675,809円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	123,266,410円
分散投資コア戦略ファンドA	276,729,621円
分散投資コア戦略ファンドS	1,457,181,560円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	981,140,587円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	732,012,974円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	397,211,932円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,455,216円

区分	2023年 2月28日現在
S M T インデックスバランス・オープン	99,920,250円
S M T 世界経済インデックス・オープン	207,091,932円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	820,219,747円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	142,032,088円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,624,698円
グローバル経済コア	400,998,891円
M y S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	106,752,393円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	35,940,397円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	32,712,302円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	14,358,751円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	20,138,850円
10資産分散投資ファンド	13,067,977円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,354,747,488円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	98,220,087円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	75,000,877円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	9,730,390円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2023年 2月28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	3,748,737,583	-	3,555,425,051	193,312,532
	合計	3,748,737,583	-	3,555,425,051	193,312,532

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

（2023年 2月28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	424,042,948	-	424,034,539	8,409

	アメリカドル	244,755,048	-	244,790,509	35,461
	ユーロ	28,915,400	-	28,917,280	1,880
	マレーシアリン ギット	76,272,500	-	76,255,750	16,750
	南アフリカランド	74,100,000	-	74,071,000	29,000
	売建	821,148	-	821,414	266
	ブラジルリアル	821,148	-	821,414	266
	合計	424,864,096	-	424,855,953	8,675

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 2月28日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,017,251,027
国債証券	524,584,751,550
地方債証券	32,104,354,617
特殊債証券	35,560,973,034
社債証券	27,908,076,000
未収入金	15,240,532,180
未収利息	1,450,213,123
前払費用	46,574,939
流動資産合計	637,912,726,470
資産合計	637,912,726,470
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	16,289,126,700
未払解約金	186,788,267
未払利息	373
流動負債合計	16,475,915,340
負債合計	16,475,915,340
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	461,587,737,670
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	159,849,073,460
元本等合計	621,436,811,130
純資産合計	621,436,811,130
負債純資産合計	637,912,726,470

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 2月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2023年 2月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	461,587,737,670口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 99,375,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3463円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,463円)</p>

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

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 2月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p>

	2023年 2月28日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	455,969,657,054円
期中追加設定元本額	21,012,436,651円
期中一部解約元本額	15,394,356,035円
期末元本額	461,587,737,670円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,237,357,792円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,925,539円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,693,471,165円
世界経済インデックスファンド	5,174,538,390円
D C マイセレクション 2 5	26,452,649,437円
D C マイセレクション 5 0	30,735,412,802円
D C マイセレクション 7 5	9,236,530,315円
D C 日本債券インデックス・オープン	436,666,850円
D C 日本債券インデックス・オープン S	91,068,100,614円
D C 日本債券インデックス・オープン P	65,427,532,022円
D C マイセレクション S 2 5	13,972,571,803円
D C マイセレクション S 5 0	15,685,738,064円
D C マイセレクション S 7 5	3,622,190,765円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	579,978,478円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,442,935,409円

区分	2023年 2月28日現在
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	947,065,059円
D C世界経済インデックスファンド	4,242,221,490円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,743,356円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	26,997,148円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	7,397,367円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	979,351円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	73,619,799円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	106,188,982円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	27,332,344円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	21,932,767円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,470,130,810円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	715,673,537円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,999,775,340円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	67,630,240円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	52,291,169円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	926,351,539円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,032,658,674円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,345,187,103円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	127,878,402円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,308,426,198円
日本債券ファンド・シリーズ1	16,942,964,156円
分散投資コア戦略ファンドA	20,107,132,935円
分散投資コア戦略ファンドS	25,039,704,682円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	244,023,714円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,686,938,305円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	98,748,430円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,490,374円
S M T インデックスバランス・オープン	75,614,390円
S M T 世界経済インデックス・オープン	40,275,377円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	85,007,946円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	136,365,912円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	13,541,152円
グローバル経済コア	228,588,275円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	36,822,352円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	23,862,389円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	41,405,766円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	23,618,544円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	7,977,168円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	7,789,903円
M y S M T 国内債券インデックス（ノーロード）	175,124,185円
10資産分散投資ファンド	286,945,825円
F O F s用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	85,497,893,588円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	39,252,687円



区分	2023年 2月28日現在
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	14,590,539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）	404,751,716円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2023年 2月28日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	248,228,335
コール・ローン	656,586,525
国債証券	67,426,823,264
派生商品評価勘定	2,135,539
未収入金	45,110
未収利息	414,427,706
前払金	2,425,513
前払費用	57,715,016
差入委託証拠金	65,558,024
流動資産合計	68,873,945,032
資産合計	68,873,945,032
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,600,037,119
未払金	108,426,074
未払解約金	371,213
未払利息	241
流動負債合計	2,708,834,647
負債合計	2,708,834,647
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	78,494,155,751
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,329,045,366
元本等合計	66,165,110,385
純資産合計	66,165,110,385
負債純資産合計	68,873,945,032

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2023年 2月28日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日まででは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 2月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	78,494,155,751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 12,329,045,366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 0.8429円 (1万口当たり純資産額) (8,429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 2月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （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 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	73,902,368,400円
期中追加設定元本額	7,166,248,543円
期中一部解約元本額	2,574,461,192円
期末元本額	78,494,155,751円

区分	2023年 2月28日現在
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	20,935,394,012円
分散投資コア戦略ファンドS	26,088,445,713円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	345,868,616円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	155,883,935円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	33,434,794円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	7,048,717円
10資産分散投資ファンド	444,351,419円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	6,101,234,034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）	2,677,738,806円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	3,263,958,827円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	3,291,415,296円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,274,448,232円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	3,173,756,238円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	3,145,272,905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）	3,438,173,542円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	2,117,730,665円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（2023年 2月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	575,267,571	-	572,842,058	2,425,513
	合計	575,267,571	-	572,842,058	2,425,513

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

（2023年 2月28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	67,031,967,921	-	69,627,443,988	2,595,476,067
	アメリカドル	33,338,660,639	-	35,062,275,807	1,723,615,168
	カナダドル	1,402,224,585	-	1,445,680,350	43,455,765
	メキシコペソ	566,243,166	-	612,918,636	46,675,470
	ユーロ	22,506,583,669	-	23,092,748,477	586,164,808
	イギリスポンド	3,314,408,175	-	3,414,975,500	100,567,325
	スウェーデンクローナ	129,002,116	-	136,344,000	7,341,884
	ノルウェークローネ	127,149,909	-	129,354,330	2,204,421
	デンマーククローネ	223,645,125	-	229,291,940	5,646,815
	ポーランドズロチ	307,996,565	-	316,529,518	8,532,953
	オーストラリアドル	1,100,803,005	-	1,106,703,585	5,900,580
	ニュージーランドドル	145,868,883	-	147,142,437	1,273,554
	シンガポールドル	311,418,864	-	319,515,500	8,096,636
	マレーシアリンギット	379,267,617	-	380,327,820	1,060,203
	イスラエルシェケル	233,368,516	-	231,706,781	1,661,735
	オフショア人民元	2,945,327,087	-	3,001,929,307	56,602,220
合計	67,031,967,921	-	69,627,443,988	2,595,476,067	

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 2月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	548,903,069
コール・ローン	4,064,638,618
国債証券	289,612,813,687
派生商品評価勘定	103,207,361
未収入金	412,456
未収利息	1,937,299,010

	2023年 2月28日現在
項目	金額（円）
前払金	35,127,656
前払費用	136,160,919
差入委託証拠金	393,222,843
流動資産合計	296,831,785,619
資産合計	296,831,785,619
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	35,228,723
未払解約金	65,383,087
未払利息	1,493
流動負債合計	100,613,303
負債合計	100,613,303
純資産の部	
元本等	
元本	97,601,672,309
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	199,129,500,007
元本等合計	296,731,172,316
純資産合計	296,731,172,316
負債純資産合計	296,831,785,619

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 2月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2023年 2月28日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 2月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,601,672,309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 3.0402円 (1万口当たり純資産額) (30,402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 2月28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 2月28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 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	101,070,365,995円
期中追加設定元本額	9,481,298,763円
期中一部解約元本額	12,949,992,449円
期末元本額	97,601,672,309円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,238,946,282円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	538,808,403円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,247,630,486円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,411,383円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,792,333,159円
世界経済インデックスファンド	15,801,192,198円
D C マイセレクション 2 5	1,924,947,383円
D C マイセレクション 5 0	1,695,461,013円
D C マイセレクション 7 5	1,185,785,937円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,275,865,384円
D C マイセレクション S 2 5	990,718,615円
D C マイセレクション S 5 0	793,152,470円
D C マイセレクション S 7 5	467,272,065円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	21,290,172円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	95,749,993円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	50,618,279円



区分	2023年 2月28日現在
D C 世界経済インデックスファンド	12,954,031,418円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	468,166,793円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,485,612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）	20,663,006円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	36,097,536円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	57,115,085円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	60,583,615円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	55,565,581円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,058,209,197円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	400,874,853円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,620,477,447円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	62,459,032円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	36,881,293円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	396,309,725円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	148,160,371円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	192,955,096円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	695,500,818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）	3,236,331,411円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	646,259,182円
外国債券ファンド・シリーズ1	734,766,627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	604,847,674円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	596,144,369円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,121,019,719円
コア投資戦略ファンド（切替型）	444,535,999円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	241,263,114円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	103,889,200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）	1,386,372,074円
SMT インデックスバランス・オープン	184,708,561円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	10,857,083,179円
SMT 世界経済インデックス・オープン	316,037,778円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	400,208,488円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	642,030,134円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,429,738円
グローバル経済コア	761,311,228円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	18,883,862円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	2,004,307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）	22,181,052円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	21,840,148円

区分	2023年 2月28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	25,613,311円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	12,714,776円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	20,065,487円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	150,317,695円
10資産分散投資ファンド	25,985,366円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	151,235,375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）	11,764,811,402円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	328,597,601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）	296,091,514円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	185,345,144円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	829,979,900円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	114,488,259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）	54,019,071円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（2023年 2月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	4,103,394,953	-	4,068,267,297	35,127,656
	合計	4,103,394,953	-	4,068,267,297	35,127,656

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

（2023年 2月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	4,471,044,427	-	4,574,150,721	103,106,294
	アメリカドル	2,359,385,314	-	2,421,620,580	62,235,266
	カナダドル	176,825,818	-	179,334,909	2,509,091
	ユーロ	1,492,640,047	-	1,522,325,928	29,685,881

	イギリスポンド	234,778,852	-	241,285,800	6,506,948
	オフショア人民元	207,414,396	-	209,583,504	2,169,108
	合計	4,471,044,427	-	4,574,150,721	103,106,294

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 2月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	995,568,675
コール・ローン	913,567,120
国債証券	95,539,023,381
未収利息	1,400,614,542
前払費用	185,964,746
流動資産合計	99,034,738,464
資産合計	99,034,738,464
負債の部	
流動負債	
未払解約金	35,994,451
未払利息	335
流動負債合計	35,994,786
負債合計	35,994,786
純資産の部	
元本等	
元本	53,169,159,963
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	45,829,583,715
元本等合計	98,998,743,678
純資産合計	98,998,743,678
負債純資産合計	99,034,738,464

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 2月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

2023年 2月28日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 2月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	53,169,159,963口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.8620円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (18,620円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2023年 2月28日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>

	2023年 2月28日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 2月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	47,776,566,303円
期中追加設定元本額	8,350,190,651円
期中一部解約元本額	2,957,596,991円
期末元本額	53,169,159,963円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,940,344,423円
世界経済インデックスファンド	16,379,742,193円
DC 新興国債券インデックス・オープン	5,375,529,007円
DC 世界経済インデックスファンド	13,427,399,405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）	35,138,878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	494,740,113円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	617,934,617円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,271,497,769円
コア投資戦略ファンド（切替型）	80,904,319円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	250,082,064円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	107,675,940円
SMT インデックスバランス・オープン	191,472,367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	407,969,430円

区分	2023年 2月28日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	516,639,456円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	828,793,752円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	11,386,867円
グローバル経済コア	789,595,151円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	19,402,087円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	3,565,644円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	36,936,509円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	30,808,051円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	12,796,777円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	17,155,121円
M y S M T 新興国債券インデックス（ノーロード）	40,095,293円
10資産分散投資ファンド	42,549,469円
F O F s用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	22,077,935円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	240,893,354円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	147,778,020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）	9,960,936円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 01（適格機関投資家専用）	257,515,051円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 08（適格機関投資家専用）	257,346,787円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 11（適格機関投資家専用）	256,020,805円
S M T A M海外バランスファンド2021 - 04（適格機関投資家専用）	250,693,866円
S M T A M海外バランスファンド2021 - 07（適格機関投資家専用）	246,972,169円
S M T A M海外バランスファンド2023 - 02（適格機関投資家専用）	162,866,450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】

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

## 【純資産額計算書】

(2023年 3月31日現在)

資産総額	1,003,579,010円
負債総額	299,829円
純資産総額（ - ）	1,003,279,181円
発行済口数	828,494,484口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2110円
（1万口当たり純資産額）	（12,110円）

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

## 【純資産額計算書】

(2023年 3月31日現在)

資産総額	788,233,324円
負債総額	231,271円
純資産総額（ - ）	788,002,053円
発行済口数	625,285,288口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2602円
（1万口当たり純資産額）	（12,602円）

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

## 【純資産額計算書】

(2023年 3月31日現在)

資産総額	343,132,339円
負債総額	91,874円
純資産総額（ - ）	343,040,465円
発行済口数	261,682,423口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3109円
（1万口当たり純資産額）	（13,109円）

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

## 【純資産額計算書】

(2023年 3月31日現在)

資産総額	423,458,124円
負債総額	1,773,000円
純資産総額（ - ）	421,685,124円
発行済口数	308,177,275口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3683円
（1万口当たり純資産額）	（13,683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 3月31日現在)

資産総額	528,009,608,503円
負債総額	549,731,582円
純資産総額（ - ）	527,459,876,921円
発行済口数	259,604,331,418口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0318円
（1万口当たり純資産額）	（20,318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 3月31日現在)

資産総額	544,400,542,383円
負債総額	673,025,424円
純資産総額（ - ）	543,727,516,959円
発行済口数	123,453,098,532口
1口当たり純資産額（ / ）	4.4043円
（1万口当たり純資産額）	（44,043円）

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書



（2023年 3月31日現在）

資産総額	129,664,660,466円
負債総額	214,703,075円
純資産総額（ - ）	129,449,957,391円
発行済口数	36,781,175,019口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5195円
（1万口当たり純資産額）	（35,195円）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2023年 3月31日現在）

資産総額	635,965,476,217円
負債総額	5,454,555,782円
純資産総額（ - ）	630,510,920,435円
発行済口数	461,944,153,214口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3649円
（1万口当たり純資産額）	（13,649円）

## 外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

（2023年 3月31日現在）

資産総額	67,218,669,295円
負債総額	341,216,318円
純資産総額（ - ）	66,877,452,977円
発行済口数	77,961,557,878口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8578円
（1万口当たり純資産額）	（8,578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 3月31日現在）

資産総額	301,090,997,995円
負債総額	72,387,715円
純資産総額（ - ）	301,018,610,280円

発行済口数	97,780,069,141口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0785円
（1万口当たり純資産額）	（30,785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 3月31日現在）

資産総額	102,296,646,807円
負債総額	9,913,094円
純資産総額（ - ）	102,286,733,713円
発行済口数	54,042,314,229口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8927円
（1万口当たり純資産額）	（18,927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。

## 受益証券の不発行

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

## 受益権の譲渡

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

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

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

### 受益権の譲渡の対抗要件

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

### 受益権の再分割

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

### 償還金

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

### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2023年 3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年間ににおける資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ 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 5月26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3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	531	14,256,696
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	68	207,566
単位型公社債投資信託	53	182,130
合計	652	14,646,392

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

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

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

(1) 【貸借対照表】

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

（単位：百万円）

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

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

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



（単位：百万円）

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

## （3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

## 注記事項

（重要な会計方針）

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### （1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4．固定資産の減価償却の方法

#### （1）有形固定資産

定額法によっております。

#### （2）無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6．引当金の計上基準

#### （1）賞与引当金

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

#### （2）退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

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

務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

## 7. 収益及び費用の計上基準

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

### (1) 投資信託委託業務

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

### (2) 投資一任業務

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

### (3) 投資助言業務

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

### (4) 成功報酬

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

## 8. ヘッジ会計の会計処理

### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

### (3) ヘッジ方針

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

### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

## 9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## 10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

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

## (会計方針の変更)

### 1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

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

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

### 2. 「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-21項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来に

わたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（未適用の会計基準等）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であり、

（追加情報）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る事業年度末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当事業年度より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、「重要な会計方針6．引当金の計上基準（2）退職給付引当金」をご参照ください。

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	"	535	"
そ の 他	4	"	-	"
計	503	"	681	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
----	-------	-----------------	-----------------	-----	-------

2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日
----------------------	------	-------	-----------	------------	------------

## 4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	配当金の原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

## 4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファ

ンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それら的一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用してあります。

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

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

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

### (1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

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

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

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

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

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

（2）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

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

#### デリバティブ取引

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

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



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

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

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

## 2. その他有価証券

前事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021年3月31日）

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### （1）通貨関連

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

##### （2）株式関連

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

#### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

当事業年度（2022年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## (2) 株式関連

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

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

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

(単位：百万円)

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

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

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

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

### 3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

#### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

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

## （セグメント情報等）

## 〔セグメント情報〕

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

## 〔関連情報〕

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

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あります。

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

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

## 投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

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

## 投信販売代行手数料等

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

## (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

前事業年度（2021年3月31日）

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

## (1株当たり情報)

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

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

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

##### 固定資産

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

固定資産合計		18,909
--------	--	--------

資産合計		76,657
------	--	--------

#### 負債の部

##### 流動負債

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

##### 固定負債

退職給付引当金		871
---------	--	-----



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

(単位：百万円)

第37期中間会計期間末

(2022年9月30日)

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

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第37期中間会計期間

(自 2022年4月1日

至 2022年9月30日)

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

法人税等合計	1,492
中間純利益	3,347

## 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

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

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

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

## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 第37期中間会計期間

（自 2022年4月1日

至 2022年9月30日）

## 1．資産の評価基準及び評価方法

## （1）有価証券

## 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

## その他有価証券

## 市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

## 市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

## （2）デリバティブ

時価法によっております。

## （3）金銭の信託

時価法によっております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

## （1）有形固定資産

定額法によっております。

## （2）無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3．引当金の計上基準

## （1）賞与引当金

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

## （2）退職給付引当金

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

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

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

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

## 4．収益及び費用の計上基準

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

## （1）投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

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

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

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

(追加情報)

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

グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱いの適用

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

## （表示方法の変更）

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

従来「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

## （中間貸借対照表関係）

第37期中間会計期間末  
（2022年9月30日）

- |   |  |        |
|---|--|--------|
| 1 | 有形固定資産の減価償却累計額                               | 777百万円 |
| 2 | 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。 |        |

## （中間損益計算書関係）

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

- |   |            |          |
|---|------------|----------|
| 1 | 減価償却実施額    |          |
|   | 有形固定資産     | 95百万円    |
|   | 無形固定資産     | 608百万円   |
| 2 | 営業外収益の主要項目 |          |
|   | デリバティブ利益   | 2,027百万円 |
|   | 投資有価証券売却益  | 317百万円   |
| 3 | 営業外費用の主要項目 |          |
|   | 為替差損       | 1,011百万円 |
|   | 金銭の信託運用損   | 904百万円   |

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．発行済株式に関する事項

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

## 2．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 配当に関する事項

#### (1) 配当金支払額

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

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

#### (リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

#### (金融商品関係)

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

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

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

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

（2）時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

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

デリバティブ取引

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

（注2）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）

第37期中間会計期間末（2022年9月30日）

1．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2．その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

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

（デリバティブ取引関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

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

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

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



原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		3,036	-	2
	英ポンド		3,333	-	19
	スイスフラン		70	-	0
	香港ドル		87	-	0
	ユーロ		82	-	0
	買建				
	米ドル		93	-	0
	英ポンド		77	-	2
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		3	-	0
	ユーロ		60	-	1
合計			6,898	-	22

## （資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （収益認識関係）

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## 2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

## 3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

## （セグメント情報等）

## [セグメント情報]

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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

## [関連情報]

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## (1)営業収益

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

## (2)有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,950百万円

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

第37期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

## (1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

## (2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

## (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2023年5月26日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2022年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・

償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

### 3【資本関係】

#### (1)受託会社

該当事項はありません。

#### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2022年3月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用すること

があります。

- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

**監査意見**

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

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

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年11月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2021年8月31日から2022年8月29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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2022年8月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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



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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年11月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2021年8月31日から2022年8月29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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2022年8月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年11月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2021年8月31日から2022年8月29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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2022年8月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2022年11月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2021年8月31日から2022年8月29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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2022年8月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

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



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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年5月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 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DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2022年8月30日から2023年2月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2023年2月28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8月30日から2023年2月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年5月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 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DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2022年8月30日から2023年2月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2023年2月28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8月30日から2023年2月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年5月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 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DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2022年8月30日から2023年2月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2023年2月28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8月30日から2023年2月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年5月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 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DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2022年8月30日から2023年2月28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、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2023年2月28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8月30日から2023年2月28日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生



する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。