世界経済インデックスファンド

追加型投信／内外／資産複合

投資信託説明書
（請求目論見書）

2022年 4月 21日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

※本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

世界経済インデックスファンドの募集については、委託会社は、金融商品取引法第５条の規定により有価証券届出書を2022年 4月20日に関東財務局長に提出しており、2022年 4月21日にその届出の効力が生じております。

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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	：	該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】 1
（1）【ファンドの名称】 1
（2）【内国投資信託受益証券の形態等】 1
（3）【発行（売出）価額の総額】 1
（4）【発行（売出）価格】 1
（5）【申込手数料】 1
（6）【申込単位】 2
（7）【申込期間】 2
（8）【申込取扱場所】 2
（9）【払込期日】 2
（１０）【払込取扱場所】 2
（１１）【振替機関に関する事項】 2
（１２）【その他】 3
第二部【ファンド情報】 4
第１【ファンドの状況】 4
１【ファンドの性格】 4
２【投資方針】 15
３【投資リスク】 27
４【手数料等及び税金】 30
５【運用状況】 34
第２【管理及び運営】 57
１【申込（販売）手続等】 57
２【換金（解約）手続等】 58
３【資産管理等の概要】 60
４【受益者の権利等】 63
第３【ファンドの経理状況】 65
１【財務諸表】 68
２【ファンドの現況】 300
第４【内国投資信託受益証券事務の概要】 303
第三部【委託会社等の情報】 304
第１【委託会社等の概況】 304
１【委託会社等の概況】 304
２【事業の内容及び営業の概況】 305
３【委託会社等の経理状況】 306
４【利害関係人との取引制限】 339
５【その他】 339
約款

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

世界経済インデックスファンド

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（※）とします。

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

（5）【申込手数料】

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

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

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

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。
「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は１円以上１円単位です。

（７）【申込期間】

2022年 4月21日から2022年10月20日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前９時から午後５時までとします。）

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞

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

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

＜受益権の取得申込みの方法＞

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

＜申込みコース＞

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

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

＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 17 項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場およ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、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

＜受付不可日＞

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

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

DR（預託証券）とは

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

＜信託金限度額＞

上限　5,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分固定型）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル（日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （　） なし	日経225 ＴＯＰＩＸ その他 （　　）	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ショート型/絶対収益追求型 その他 （　　）

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

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

［投資対象地域による区分］

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

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

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

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

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

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

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

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

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

［独立した区分］

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

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

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

［補足分類］

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

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］

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

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

(3)年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
(4)年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
(5)年 12 回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年 12 回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
(6)日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

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

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

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

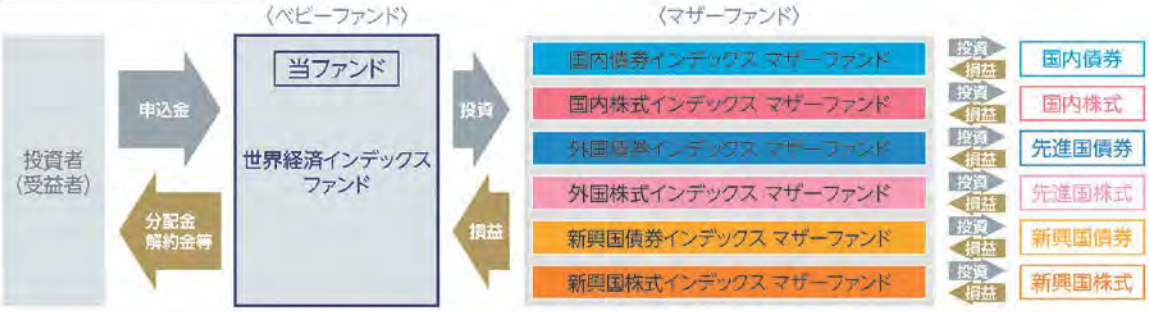
(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

＜ファンドの特色＞

1. 世界の債券及び株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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

ファンドのしくみ

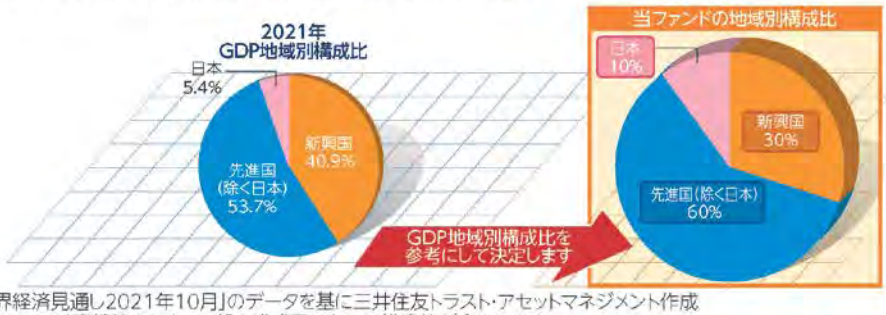


？ ファミリーファンド方式とは

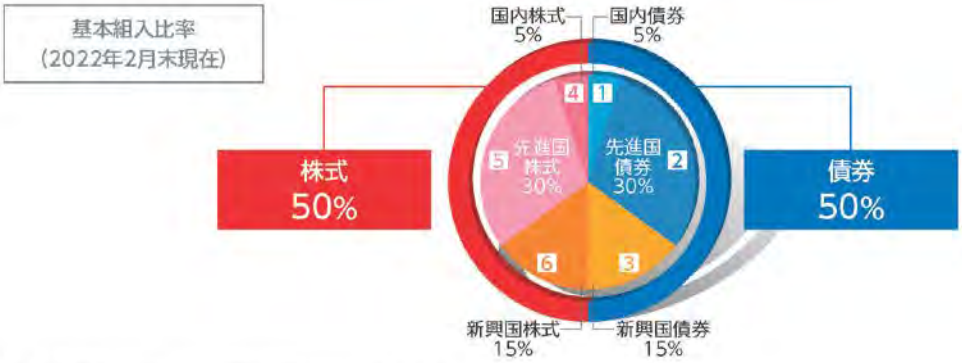
投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

2. 世界経済全体の発展を享受します。

●基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定します。
※世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回地域別構成比の見直しを行う場合があります。
※地域別の基本組入比率は市場動向等を勘案して調整を行うことがあります。



（出所）IMF「世界経済見通し2021年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。
※上記のファンドの地域別構成比は、2022年2月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



●基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
●基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合もあります。

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

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

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

※1「NOMURA-BPI 総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

※2「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および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏また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。

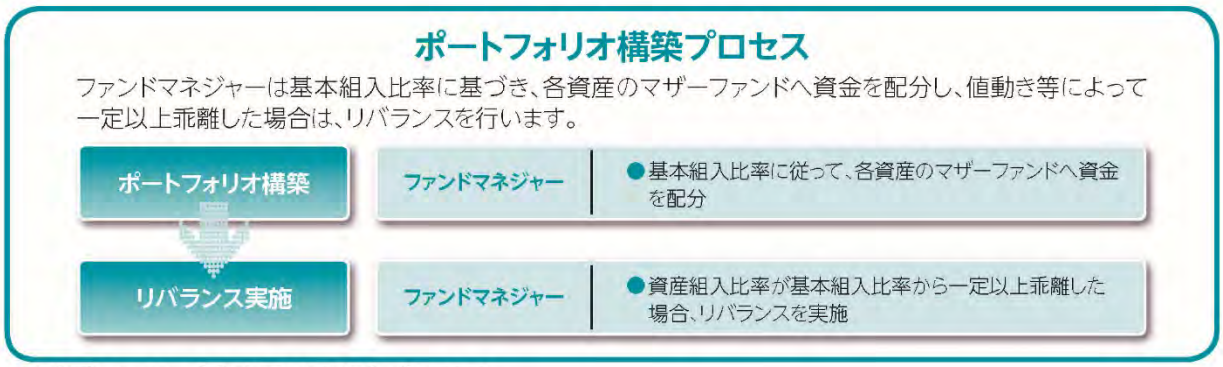
※3「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るために JP モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利は JP モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属

します。

※4「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社 JPX 総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社 JPX 総研又は株式会社 JPX 総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は JPX が有します。JPX は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPX により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても JPX は責任を負いません。

※5「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。

※6「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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

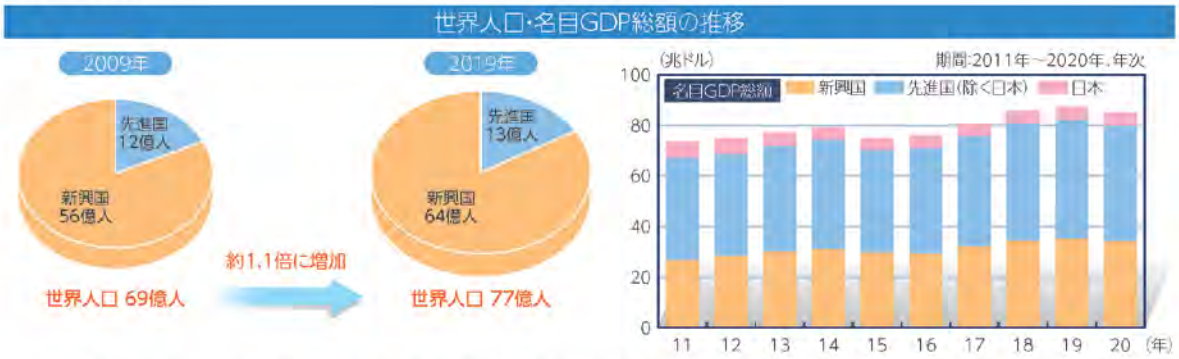
●年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。
●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

〈ご参考情報〉



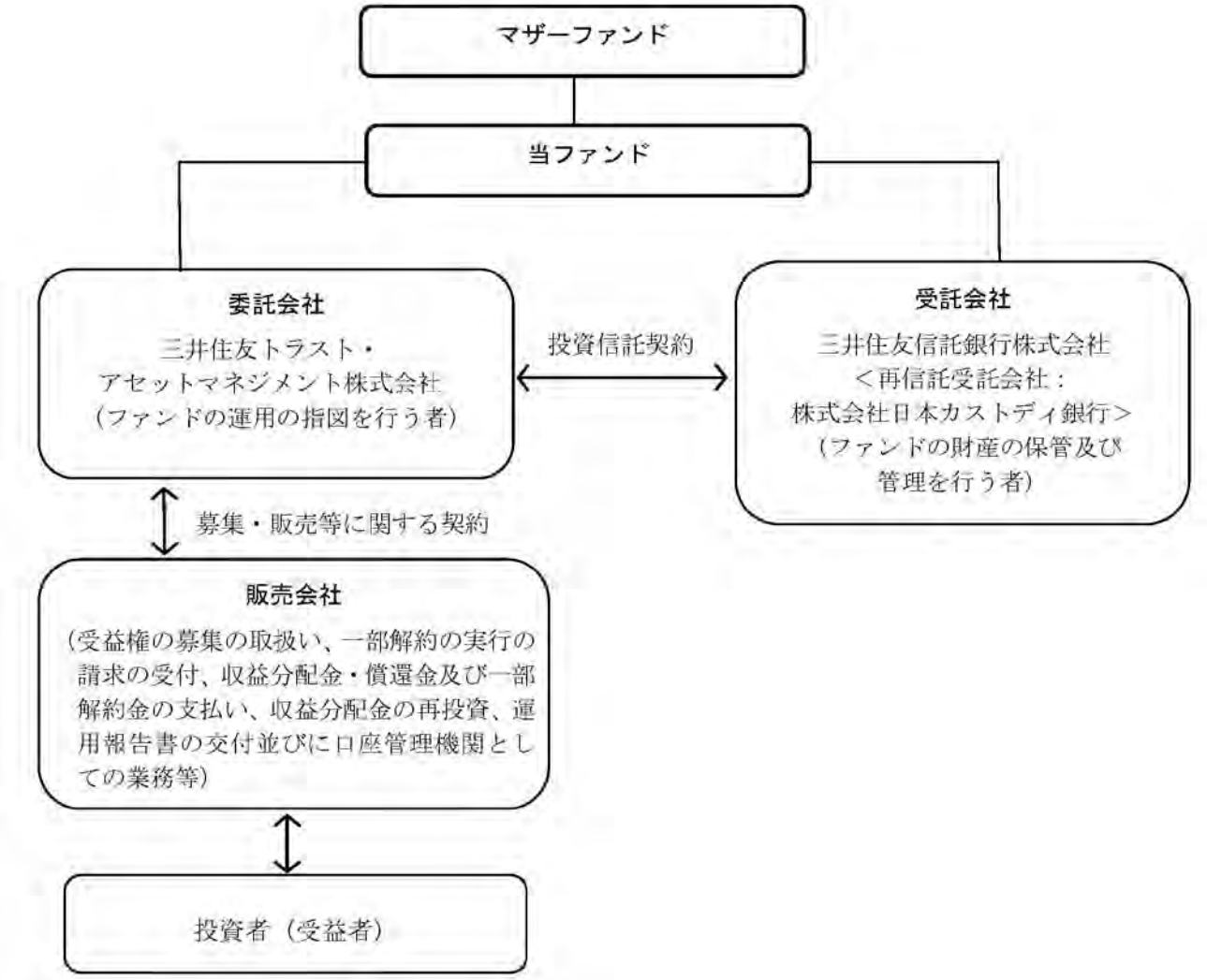
(出所)国連「World Population Prospects 2019」及びIMF「世界経済見通し2021年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

(2)【ファンドの沿革】

2009年 1月 16日	当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2012年 4月 1日	当ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の名称を「国内債券インデックス マザーファンド」に、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国債券インデックス マザーファンド」の名称を「新興国債券インデックス マザーファンド」に、「住信 新興国株式インデックス マザーファンド」の名称を「新興国株式インデックス マザーファンド」にそれぞれ変更

（3）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2022 年 2 月 28 日現在）

イ．資本金の額：20 億円

ロ．委託会社の沿革

1986 年 11 月 1 日：　住信キャピタルマネジメント株式会社設立

1987 年 2 月 20 日：　投資顧問業の登録

1987 年 9 月 9 日：　投資一任契約に係る業務の認可

1990 年 10 月 1 日：　住信投資顧問株式会社に商号変更

1999 年 2 月 15 日：　住信アセットマネジメント株式会社に商号変更

1999 年 3 月 25 日：　証券投資信託委託業の認可

2007 年 9 月 30 日：　金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第 347 号）

2012 年 4 月 1 日：　中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

2018 年 10 月 1 日：　三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ．大株主の状況

株　主　名	住　　所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目 4 番 1 号	3,000 株	100%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下、総称して又は個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称して又は個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

②投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

③投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

ロ．株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式50%、債券50%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合もあります。

ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のＧＤＰ（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。

ホ．実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。

ヘ．投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所（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および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）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。

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

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、投資信託約款第 21 条、第 22 条及び第 23 条に定めるものに限ります。）
3. 金銭債権
4. 約束手形

ロ. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

②有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として次に掲げる 1. から 6. までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券並びに 7. から 28. までの有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

25. 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。）
26. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
27. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
28. 外国の者に対する権利で上記 27. の有価証券の性質を有するもの

なお、上記 7. の証券又は証書、上記 18. 並びに 23. の証券又は証書のうち上記 7. の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記 8. から 12. までの証券及び上記 18. 並びに 23. の証券又は証書のうち上記 8. から 12. までの証券の性質を有するもの、及び上記 20. に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、上記 19. 及び 20. の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

ロ．上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考) マザーファンドの概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①NOMURA-BPI 総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場に

おける有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。
③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
⑤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。
⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。
⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことがで

きます。

⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①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。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①原則として MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

⑤同一銘柄の転換社債並びに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。

⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

②組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

①株式への投資は行いません。

②同一銘柄の転換社債並びに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。

③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

⑴投資対象

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

⑵投資態度

①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。

③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

３．運用制限

①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

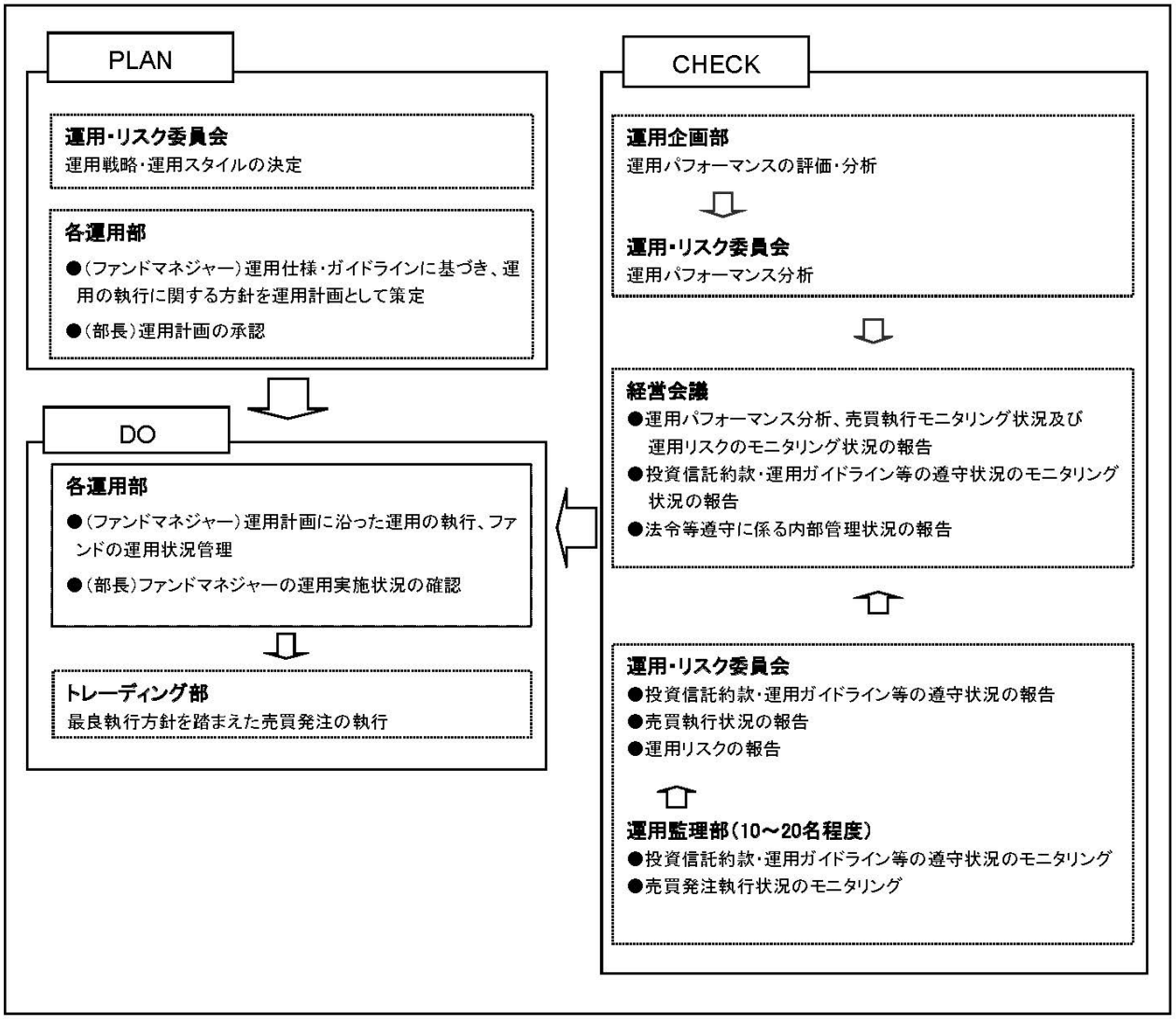
③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

（3）【運用体制】

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



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

務規則を定めています。

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

（4）【分配方針】

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（5）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。

ロ．投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

ハ．外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ホ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

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

除きます。）の行使により取得可能な株券

ヘ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

チ．委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。

リ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ヌ．委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済について

は、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ル．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、この指図は、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。

ヲ．委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

カ．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。

ヨ．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。

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

３【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク

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

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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＞

①同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

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

場合も同様です。

③ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第 37 条の 6 の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

④ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

*2017年3月～2022年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、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用い、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

①取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜　3.0%）（※1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

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

②「分配金再投資コース」（※2）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

※2：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

③上記①及び②の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞
ありません。
＜信託財産留保額＞
ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（※）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有する新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率　0.55％（税抜　0.5％）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.22％　　（税抜　0.2％）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率　0.275％　　（税抜　0.25％）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率　0.055％　　（税抜　0.05％）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（4）【その他の手数料等】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（5）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニア NISA（ジュニアニーサ）」及び非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。つみたてNISAは一定の基準を満たした公募株式投資信託に係る非課税制度で、当ファンドはその適用対象です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、同一年中はNISAとつみたてNISAの同時利用はできません。また、ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税　率　（所得税のみ）
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場

合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は、2022 年 2 月 28 日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

※税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

以下は、2022年2月28日現在の状況について記載してあります。

【世界経済インデックスファンド】

（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	127,966,420,289	98.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,431,273,859	1.11
合計(純資産総額)		129,397,694,148	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(％)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス　マザーファンド	9,865,285,003	4.1281	40,725,282,170	4.0194	39,652,526,541	30.64
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	12,784,868,904	3.0544	39,050,564,990	3.0088	38,467,113,558	29.73
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	11,262,862,950	1.7501	19,711,434,078	1.7311	19,497,142,052	15.07
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス　マザーファンド	5,402,561,344	3.6686	19,820,121,889	3.5072	18,947,863,145	14.64
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	3,593,115,748	1.8899	6,790,849,858	1.8414	6,616,363,338	5.11
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	3,438,042,715	1.4033	4,824,779,393	1.3919	4,785,411,655	3.70

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	98.89
合計	98.89

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		１万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第４期計算期間末 （2013年 1月 21日）	2,751,494,290	2,755,095,142	15,282	15,302
第５期計算期間末 （2014年 1月 20日）	4,684,090,831	4,689,249,062	18,162	18,182
第６期計算期間末 （2015年 1月 20日）	10,344,646,326	10,354,724,017	20,530	20,550
第７期計算期間末 （2016年 1月 20日）	16,216,119,873	16,216,119,873	18,276	18,276
第８期計算期間末 （2017年 1月 20日）	22,647,406,597	22,647,406,597	20,148	20,148
第９期計算期間末 （2018年 1月 22日）	54,410,632,155	54,410,632,155	23,375	23,375
第10期計算期間末 （2019年 1月 21日）	58,898,515,081	58,898,515,081	21,463	21,463
第11期計算期間末 （2020年 1月 20日）	68,600,065,515	68,600,065,515	24,407	24,407
第12期計算期間末 （2021年 1月 20日）	82,775,453,215	82,775,453,215	25,904	25,904
第13期計算期間末 （2022年 1月 20日）	128,500,213,822	128,500,213,822	28,327	28,327
2021年 2月末日	84,790,141,595	—	26,188	—
3月末日	90,279,987,589	—	26,977	—
4月末日	94,158,621,846	—	27,474	—
5月末日	97,951,743,086	—	27,822	—
6月末日	102,454,387,413	—	28,127	—
7月末日	105,441,978,290	—	27,931	—
8月末日	111,102,661,794	—	28,193	—
9月末日	114,138,859,850	—	27,904	—
10月末日	120,892,545,707	—	28,859	—
11月末日	122,607,706,368	—	28,358	—
12月末日	128,903,615,932	—	28,966	—
2022年 1月末日	128,317,331,363	—	28,006	—
2月末日	129,397,694,148	—	27,671	—

②【分配の推移】

	期　間	１万口当たりの分配金（円）
第４期計算期間	2012年 1月 21日～2013年 1月 21日	20
第５期計算期間	2013年 1月 22日～2014年 1月 20日	20
第６期計算期間	2014年 1月 21日～2015年 1月 20日	20
第７期計算期間	2015年 1月 21日～2016年 1月 20日	0
第８期計算期間	2016年 1月 21日～2017年 1月 20日	0
第９期計算期間	2017年 1月 21日～2018年 1月 22日	0
第10期計算期間	2018年 1月 23日～2019年 1月 21日	0
第11期計算期間	2019年 1月 22日～2020年 1月 20日	0

第12期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	0
第13期計算期間	2021年 1月21日～2022年 1月20日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第4期計算期間	2012年 1月21日～2013年 1月21日	27.5
第5期計算期間	2013年 1月22日～2014年 1月20日	19.0
第6期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	13.1
第7期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	△11.0
第8期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	10.2
第9期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	16.0
第10期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	△8.2
第11期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	13.7
第12期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	6.1
第13期計算期間	2021年 1月21日～2022年 1月20日	9.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（4）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第4期計算期間	2012年 1月21日～2013年 1月21日	907,508,119	554,585,762	1,800,426,112
第5期計算期間	2013年 1月22日～2014年 1月20日	1,918,803,387	1,140,113,813	2,579,115,686
第6期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	3,411,351,368	951,621,550	5,038,845,504
第7期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	5,409,151,344	1,574,902,402	8,873,094,446
第8期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	4,258,831,911	1,891,370,889	11,240,555,468
第9期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	30,368,454,269	18,331,594,089	23,277,415,648
第10期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	11,121,535,048	6,956,801,315	27,442,149,381
第11期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	8,633,804,962	7,968,996,991	28,106,957,352
第12期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	10,639,014,321	6,790,775,126	31,955,196,547
第13期計算期間	2021年 1月21日～2022年 1月20日	18,862,758,575	5,454,380,147	45,363,574,975

(注)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	517,900,276,550	83.48
地方債証券	日本	33,871,381,166	5.46
特殊債券	日本	37,323,553,271	6.02
社債券	日本	27,427,145,780	4.42
	フランス	1,400,234,000	0.23
	スペイン	400,420,000	0.06
	オーストラリア	400,180,000	0.06
	小計	29,627,979,780	4.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,677,354,505	0.27
合計(純資産総額)		620,400,545,272	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(％)	償還期限	投資比率(％)
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	7,650,000,000	100.71	7,704,922,000	100.31	7,674,403,500	0.100	2024/9/20	1.24
日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	6,950,000,000	100.55	6,988,225,000	100.04	6,952,988,500	0.005	2026/6/20	1.12
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	6,880,000,000	101.05	6,952,240,000	100.42	6,909,033,600	0.100	2028/3/20	1.11
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	6,890,000,000	100.59	6,931,220,300	100.26	6,908,051,800	0.100	2023/12/20	1.11
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	100.54	6,796,706,800	100.24	6,776,291,600	0.100	2023/9/20	1.09
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	6,310,000,000	100.91	6,367,421,000	100.38	6,333,978,000	0.100	2025/6/20	1.02
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	5,900,000,000	100.98	5,957,820,000	100.45	5,926,845,000	0.100	2026/9/20	0.96
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	5,820,000,000	100.95	5,875,290,000	100.39	5,842,756,200	0.100	2025/9/20	0.94
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	5,750,000,000	101.01	5,808,075,000	100.45	5,776,105,000	0.100	2027/3/20	0.93
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	5,750,000,000	100.68	5,789,422,500	100.29	5,767,192,500	0.100	2024/6/20	0.93
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	5,760,000,000	100.57	5,792,887,000	99.54	5,733,561,600	0.100	2031/6/20	0.92
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	5,590,000,000	100.66	5,626,894,000	100.28	5,606,043,300	0.100	2024/3/20	0.90

日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	5,340,000,000	101.84	5,438,463,400	101.18	5,403,012,000	0.300	2025/12/20	0.87
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	5,110,000,000	101.04	5,163,322,500	100.40	5,130,848,800	0.100	2028/6/20	0.83
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	5,070,000,000	101.05	5,123,738,800	100.43	5,092,003,800	0.100	2027/12/20	0.82
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	5,050,000,000	100.96	5,098,480,000	100.42	5,071,462,500	0.100	2026/3/20	0.82
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	4,830,000,000	102.24	4,938,192,000	101.45	4,900,421,400	0.400	2025/9/20	0.79
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	4,890,000,000	100.46	4,912,494,000	99.91	4,885,843,500	0.100	2030/9/20	0.79
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	4,860,000,000	100.44	4,881,766,400	100.02	4,861,069,200	0.005	2026/9/20	0.78
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	4,800,000,000	101.87	4,889,760,000	101.15	4,855,488,000	0.600	2023/12/20	0.78
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	4,800,000,000	100.97	4,846,624,600	100.40	4,819,536,000	0.100	2028/12/20	0.78
日本	国債証券	第３３９回利付国債（１０年）	4,750,000,000	102.13	4,851,175,000	101.35	4,814,362,500	0.400	2025/6/20	0.78
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	4,720,000,000	100.80	4,758,136,000	100.35	4,736,567,200	0.100	2025/3/20	0.76
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	4,640,000,000	101.05	4,688,720,000	100.44	4,660,555,200	0.100	2027/9/20	0.75
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	4,560,000,000	102.00	4,651,382,400	101.26	4,617,775,200	0.400	2025/3/20	0.74
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	4,540,000,000	100.88	4,580,290,000	100.38	4,557,524,400	0.100	2029/3/20	0.73
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	4,510,000,000	101.03	4,556,755,000	100.39	4,527,679,200	0.100	2028/9/20	0.73
日本	国債証券	第３２９回利付国債（１０年）	4,410,000,000	101.84	4,491,372,900	101.12	4,459,480,200	0.800	2023/6/20	0.72
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	4,370,000,000	100.80	4,404,960,000	100.33	4,384,683,200	0.100	2024/12/20	0.71
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	4,330,000,000	100.48	4,350,784,000	100.20	4,339,006,400	0.100	2023/6/20	0.70

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.48
地方債証券	5.46
特殊債券	6.02
社債券	4.78
合計	99.73

(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。

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	463,886,730,280	99.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,076,044,359	0.66
合計(純資産総額)		466,962,774,639	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	3,006,690,000	0.64

(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	9,112,600	1,836.22	16,732,786,826	2,138.50	19,487,295,100	4.17
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,127,000	10,891.26	12,274,452,500	11,810.00	13,309,870,000	2.85
日本	株式	キーエンス	電気機器	163,000	54,555.16	8,892,491,625	53,780.00	8,766,140,000	1.88
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,127,900	619.94	6,898,735,425	712.80	7,931,967,120	1.70
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,326,200	5,735.22	7,606,057,959	4,819.00	6,390,957,800	1.37
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	114,200	49,256.11	5,625,048,380	55,770.00	6,368,934,000	1.36
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,846,800	2,937.88	5,425,681,264	3,293.00	6,081,512,400	1.30
日本	株式	任天堂	その他製品	101,600	66,915.51	6,798,615,958	58,020.00	5,894,832,000	1.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,058,600	8,129.35	8,605,732,736	5,125.00	5,425,325,000	1.16
日本	株式	信越化学工業	化学	302,500	18,851.35	5,702,535,080	17,670.00	5,345,175,000	1.14
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	351,000	14,495.78	5,088,020,160	14,855.00	5,214,105,000	1.12
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,327,700	3,114.56	4,135,203,560	3,871.00	5,139,526,700	1.10
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,228,200	3,944.52	4,844,670,510	4,121.00	5,061,412,200	1.08

日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,416,500	3,355.15	4,752,582,120	3,525.00	4,993,162,500	1.07
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,414,000	3,698.21	5,229,270,360	3,501.00	4,950,414,000	1.06
日本	株式	日立製作所	電気機器	865,300	5,781.33	5,002,590,150	5,650.00	4,888,945,000	1.05
日本	株式	ダイキン工業	機械	229,200	21,763.87	4,988,280,592	21,205.00	4,860,186,000	1.04
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,287,000	3,699.01	4,760,636,760	3,756.00	4,833,972,000	1.04
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,239,300	3,255.62	4,034,701,692	3,743.00	4,638,699,900	0.99
日本	株式	日本電産	電気機器	466,400	12,527.65	5,842,896,150	9,883.00	4,609,431,200	0.99
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	203,200	16,532.46	3,359,396,460	21,130.00	4,293,616,000	0.92
日本	株式	村田製作所	電気機器	528,600	8,305.40	4,390,237,320	7,787.00	4,116,208,200	0.88
日本	株式	第一三共	医薬品	1,413,800	2,535.72	3,585,011,551	2,793.50	3,949,450,300	0.85
日本	株式	三井物産	卸売業	1,376,000	2,425.66	3,337,717,416	2,865.50	3,942,928,000	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,673,900	1,465.22	3,917,874,783	1,450.50	3,878,491,950	0.83
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	693,200	4,752.03	3,294,112,360	5,591.00	3,875,681,200	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	584,400	5,217.64	3,049,191,494	6,574.00	3,841,845,600	0.82
日本	株式	ＳＭＣ	機械	52,700	65,792.34	3,467,256,546	68,050.00	3,586,235,000	0.77
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,269,300	1,663.50	3,774,998,304	1,525.00	3,460,682,500	0.74
日本	株式	ファナック	電気機器	157,900	26,170.43	4,132,312,420	21,155.00	3,340,374,500	0.72

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別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	0.28
		建設業	2.30
		食料品	3.41
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.22
		化学	6.58
		医薬品	5.01
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.77
		鉄鋼	0.86
		非鉄金属	0.82
		金属製品	0.60
		機械	5.20
		電気機器	17.54
		輸送用機器	8.45

		精密機器	2.63
		その他製品	2.38
		電気・ガス業	1.17
		陸運業	3.06
		海運業	0.64
		空運業	0.43
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.02
		卸売業	5.68
		小売業	4.35
		銀行業	5.39
		証券、商品先物取引業	0.78
		保険業	2.17
		その他金融業	1.13
		不動産業	1.96
		サービス業	5.69
		小計	99.34
合計			99.34

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物	買建	159	円	3,076,056,750	3,006,690,000	0.64

(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	142,480,624,300	47.08
	フランス	28,984,938,430	9.58
	イタリア	25,416,539,030	8.40
	ドイツ	21,337,803,940	7.05
	イギリス	16,911,466,769	5.59

	スペイン	16,848,035,162	5.57
	ベルギー	6,486,662,445	2.14
	カナダ	6,007,997,024	1.99
	オランダ	5,382,732,381	1.78
	オーストラリア	4,649,861,458	1.54
	オーストリア	4,113,486,782	1.36
	中国	2,737,401,726	0.90
	アイルランド	2,298,541,131	0.76
	メキシコ	2,160,343,706	0.71
	フィンランド	1,726,087,853	0.57
	マレーシア	1,524,728,687	0.50
	ポーランド	1,336,319,140	0.44
	シンガポール	1,319,711,166	0.44
	イスラエル	1,271,254,708	0.42
	デンマーク	1,268,919,735	0.42
	スウェーデン	822,255,302	0.27
	ノルウェー	726,052,121	0.24
	小計	295,811,762,996	97.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	6,811,142,199	2.25
合計(純資産総額)		302,622,905,195	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	1,978,432,679	0.65
	買建	ドイツ	2,198,449,536	0.73

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	―	4,367,074,102	1.44

(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 0.625% 08/15/30	15,950,000	10,654.97	1,699,468,335	10,361.58	1,652,672,832	0.625	2030/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	15,150,000	11,870.17	1,798,331,458	10,808.43	1,637,478,467	2.000	2051/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	11,090.99	1,669,194,676	10,770.52	1,620,963,844	1.125	2031/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	11,473.89	1,663,714,841	11,051.27	1,602,434,761	1.250	2028/9/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.75% 08/15/41	14,500,000	11,293.06	1,637,493,715	10,393.18	1,507,011,232	1.750	2041/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,698.30	1,508,461,023	10,400.40	1,466,456,793	0.625	2030/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	11,556.80	1,502,384,711	11,243.55	1,461,662,371	0.250	2024/3/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/51	13,600,000	10,794.93	1,468,111,610	10,489.77	1,426,609,187	1.875	2051/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	12,680,000	11,289.87	1,431,556,050	10,842.74	1,374,859,765	1.250	2031/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/23	12,000,000	11,510.39	1,381,247,724	11,339.69	1,360,763,746	0.250	2023/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	11,326.90	1,339,972,779	10,996.65	1,300,904,738	0.750	2026/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	11,428.61	1,314,290,977	10,949.71	1,259,217,412	0.500	2026/2/28	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	11,770.55	1,312,416,407	11,229.11	1,252,046,094	1.625	2031/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.25% 11/15/23	11,000,000	11,494.79	1,264,427,829	11,312.61	1,244,387,743	0.250	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	11,552.74	1,270,801,751	11,051.27	1,215,640,164	0.750	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	12,286.66	1,247,096,617	11,718.84	1,189,462,901	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,232.05	1,250,115,589	11,620.89	1,187,655,945	2.000	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,873.43	1,212,388,069	10,561.99	1,177,662,128	0.875	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	11,581.63	1,175,535,515	11,430.42	1,160,187,899	0.250	2023/4/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	11,524.75	1,152,475,837	11,251.68	1,125,168,125	0.125	2024/1/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	11,493.75	1,149,375,272	11,207.89	1,120,789,866	0.250	2024/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	11,312.57	1,155,014,020	10,971.83	1,120,224,210	1.125	2028/8/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	11,161.40	1,116,140,782	10,733.96	1,073,396,306	0.625	2027/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,386.86	1,108,624,843	11,760.82	1,052,593,697	2.250	2027/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,500,000	11,702.55	1,111,742,949	11,076.55	1,052,272,324	1.250	2028/6/30	0.35
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,049.92	1,096,193,963	12,404.47	1,041,975,741	3.125	2028/11/15	0.34
フランス	国債証券	FRTR 2.75% 10/25/27	6,910,000	15,406.74	1,064,605,779	14,789.12	1,021,928,442	2.750	2027/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	9,230,000	11,261.18	1,039,407,736	10,948.36	1,010,533,859	1.375	2031/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	11,552.11	1,040,845,223	11,209.25	1,009,953,676	0.375	2024/7/15	0.33
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	11,519.87	1,036,788,552	11,191.19	1,007,207,829	0.250	2024/6/15	0.33

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	97.75
合計	97.75

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	53	アメリカドル	6,223,531.47	719,129,061	6,224,187.5	719,204,866	0.24
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	40	アメリカドル	5,048,846.38	583,394,199	5,046,875.2	583,166,429	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	38	アメリカドル	5,860,747.21	677,209,340	5,850,812.5	676,061,384	0.22
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	23	ユーロ	2,573,298.3	332,830,402	2,570,365	332,451,009	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	34	ユーロ	4,495,861.4	581,494,713	4,458,080	576,608,067	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	60	ユーロ	10,133,576	1,310,676,720	9,969,000	1,289,390,460	0.43

(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	19,060,000.00	2,201,484,024	2,201,361,384	0.73
	カナダドル	買建	1,860,000.00	169,245,241	168,297,450	0.06
	ユーロ	買建	13,340,000.00	1,757,833,198	1,725,467,636	0.57
	イギリスポンド	買建	1,760,000.00	274,979,495	271,947,632	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。

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	334,522,979,542	67.06
	イギリス	21,286,882,442	4.27
	カナダ	18,294,627,640	3.67
	スイス	16,347,938,142	3.28
	フランス	15,280,348,865	3.06
	ドイツ	12,297,459,285	2.47
	オーストラリア	9,492,518,753	1.90
	オランダ	9,054,757,376	1.82
	アイルランド	8,695,749,791	1.74

	スウェーデン	4,750,523,401	0.95
	デンマーク	3,716,032,609	0.74
	スペイン	3,417,869,475	0.69
	香港	3,143,882,966	0.63
	イタリア	2,701,273,017	0.54
	フィンランド	1,725,885,797	0.35
	ジャージー	1,595,685,921	0.32
	シンガポール	1,529,316,884	0.31
	ベルギー	1,207,421,973	0.24
	バミューダ	1,085,159,599	0.22
	イスラエル	1,046,444,165	0.21
	ノルウェー	1,022,465,355	0.20
	ケイマン	912,812,258	0.18
	キュラソー	488,328,247	0.10
	ルクセンブルク	426,163,742	0.09
	ニュージーランド	398,589,726	0.08
	オーストリア	323,573,635	0.06
	ポルトガル	220,616,753	0.04
	リベリア	162,278,873	0.03
	パナマ	151,411,197	0.03
	マン島	127,160,175	0.03
	ロシア	6,909,324	0.00
	小計	475,433,066,928	95.31
投資信託受益証券	オーストラリア	126,310,589	0.03
	香港	84,449,421	0.02
	小計	210,760,010	0.04
投資証券	アメリカ	9,346,477,391	1.87
	オーストラリア	659,007,096	0.13
	イギリス	306,960,920	0.06
	フランス	245,162,072	0.05
	シンガポール	205,447,358	0.04
	香港	160,127,632	0.03
	カナダ	58,834,325	0.01
	小計	10,982,016,794	2.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	12,181,957,707	2.44
合計(純資産総額)		498,807,801,439	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	買建	国／地域	時価合計（円）	投資

種類	／ 売建			比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,261,794,700	1.86
	買建	カナダ	624,452,220	0.13
	買建	ドイツ	2,115,073,997	0.42
	買建	イギリス	218,881,415	0.04
	買建	オーストラリア	418,084,590	0.08

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

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

資産の 種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	626,242,518	0.13
	売建	—	369,748,480	△0.07

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

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

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	1,291,969	14,398.68	18,602,655,307	19,048.41	24,609,964,909	4.93
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	557,977	28,850.52	16,097,928,830	34,354.17	19,168,836,993	3.84
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,599	374,078.10	13,316,806,406	355,405.22	12,652,070,551	2.54
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	23,507	272,334.01	6,401,755,749	310,735.90	7,304,468,907	1.46
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	22,496	278,655.75	6,268,639,932	310,874.56	6,993,434,203	1.40
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	65,692	74,488.15	4,893,275,682	93,580.47	6,147,488,794	1.23
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	195,119	18,810.38	3,670,263,414	27,913.41	5,446,437,329	1.09
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	186,018	37,984.75	7,065,847,504	24,320.96	4,524,137,081	0.91
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,563	47,597.35	3,501,404,299	54,972.91	4,043,972,362	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	233,132	18,977.93	4,424,363,243	17,097.93	3,986,075,433	0.80
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・	205,370	19,556.83	4,016,387,717	19,181.30	3,939,263,581	0.79

			バイオテクノロジー・ライフサイエンス						
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	103,390	33,444.79	3,457,857,045	36,888.18	3,813,869,137	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	189,391	15,581.91	2,951,074,937	18,284.63	3,462,944,739	0.69
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	131,624	26,264.51	3,457,040,522	25,336.64	3,334,911,022	0.67
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	219,354	13,874.44	3,043,414,614	14,795.90	3,245,542,042	0.65
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	590,618	4,898.16	2,892,944,121	5,202.06	3,072,430,864	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	82,306	36,850.05	3,032,980,257	36,588.90	3,011,486,621	0.60
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	330,112	6,744.65	2,226,491,056	8,994.41	2,969,163,334	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	68,686	41,665.01	2,861,803,495	42,648.34	2,929,344,534	0.59
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,248	71,434.48	2,303,619,175	76,194.19	2,457,110,368	0.49
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	141,614	20,643.00	2,923,338,864	17,278.19	2,446,833,811	0.49
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	150,711	11,992.93	1,807,467,151	16,220.90	2,444,669,416	0.49
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	437,000	4,475.25	1,955,684,906	5,514.04	2,409,638,102	0.48
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	54,689	39,405.81	2,155,064,671	43,626.08	2,385,866,908	0.48
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	137,691	13,080.26	1,801,034,080	17,279.34	2,379,210,568	0.48
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	319,753	6,388.75	2,042,825,017	7,262.31	2,322,147,808	0.47
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	31,960	54,721.01	1,748,883,592	67,944.55	2,171,507,994	0.44
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	328,253	6,112.59	2,006,477,647	6,475.42	2,125,576,698	0.43
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	107,665	17,094.46	1,840,475,789	19,456.30	2,094,763,508	0.42
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	34,433	43,709.09	1,505,035,389	59,795.96	2,058,954,618	0.41

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	4.12
		素材	4.23
		資本財	5.95
		商業・専門サービス	1.16
		運輸	1.93
		自動車・自動車部品	2.18
		耐久消費財・アパレル	1.74
		消費者サービス	1.80
		メディア・娯楽	6.25
		小売	5.06
		食品・生活必需品小売り	1.44
		食品・飲料・タバコ	3.93
		家庭用品・パーソナル用品	1.71
		ヘルスケア機器・サービス	4.74
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.82
		銀行	6.27
		各種金融	4.74
		保険	3.04
		不動産	0.45
		ソフトウェア・サービス	11.04
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.46
		電気通信サービス	1.53
		公益事業	2.84
		半導体・半導体製造装置	4.89
		小計	95.31
投資信託受益証券	—	—	0.04
投資証券	—	—	2.20
合計			97.56

(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	地域	取引所	資産の名称	買建	数量	通貨	簿価金額	帳簿価額	評価金額	評価金額	投資

種類				／売建			(現地通貨)	(円)	(現地通貨)	(円)	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	366	アメリカドル	83,327,272	9,628,466,280	80,154,000	9,261,794,700	1.86
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	27	カナダドル	6,842,129.5	619,349,562	6,898,500	624,452,220	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	51	スイスフラン	6,246,127	779,891,417	6,064,920	757,265,911	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	265	ユーロ	10,917,252.5	1,412,037,438	10,497,975	1,357,808,086	0.27
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	29	オーストラリアドル	5,230,878	433,901,330	5,040,200	418,084,590	0.08
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	19	イギリスポンド	1,396,586.25	215,884,302	1,415,975	218,881,415	0.04

(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	5,420,000.00	626,172,600	626,242,518	0.13
	アメリカドル	売建	3,200,000.00	369,792,000	369,748,480	△0.07

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

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

新興国債券インデックス　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	インドネシア	8,329,395,418	10.06
	中国	8,317,413,515	10.05
	タイ	7,721,270,300	9.33
	メキシコ	7,670,570,534	9.27
	マレーシア	7,241,235,315	8.75
	ブラジル	7,210,949,114	8.71
	南アフリカ	6,936,290,755	8.38
	ポーランド	5,680,064,187	6.86
	チェコ	3,860,959,746	4.66
	ロシア	3,774,612,068	4.56
	コロンビア	3,242,231,531	3.92
	ハンガリー	2,776,574,042	3.35

	ルーマニア	2,555,537,401	3.09
	ペルー	1,841,518,945	2.22
	チリ	1,687,820,839	2.04
	トルコ	813,408,280	0.98
	ドミニカ共和国	117,079,661	0.14
	ウルグアイ	115,457,182	0.14
	フィリピン	107,503,305	0.13
	小計	79,999,892,138	96.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	2,785,209,314	3.36
合計(純資産総額)		82,785,101,452	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(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	64,600,000,000	3.39	2,193,891,683	3.13	2,028,078,412	9.850	2027/6/28	2.45
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000	1,756.94	1,618,145,060	1,821.61	1,677,707,970	0.000	2024/1/1	2.03
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	70,000,000	1,856.06	1,299,243,797	1,918.54	1,342,979,391	0.000	2023/7/1	1.62
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	146,600,000	831.96	1,219,665,014	832.22	1,220,046,482	10.500	2026/12/21	1.47
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	47,600,000	2,193.69	1,044,201,196	2,200.95	1,047,653,880	10.000	2023/1/1	1.27
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	176,300,000	533.16	939,972,350	522.45	921,085,119	5.750	2026/3/5	1.11
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	140,600,000	632.05	888,672,399	640.58	900,666,700	8.750	2048/2/28	1.09
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	159,500,000	570.49	909,932,979	554.99	885,215,250	7.500	2027/6/3	1.07
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000	2,117.60	872,451,845	2,145.81	884,074,977	10.000	2027/1/1	1.07
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	34,000,000,000	2.77	942,154,893	2.47	840,640,587	7.250	2034/10/18	1.02
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	29,800,000	2,823.11	841,287,367	2,790.04	831,434,326	3.885	2029/8/15	1.00
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	117,700,000	695.87	819,046,758	699.28	823,059,787	8.000	2030/1/31	0.99
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	136,900,000	603.54	826,256,422	582.76	797,804,805	8.500	2029/5/31	0.96
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000	2,852.29	741,597,303	2,837.27	737,692,353	3.955	2025/9/15	0.89
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	41,850,000	1,682.10	703,960,636	1,734.60	725,930,332	0.000	2024/7/1	0.88
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	575.46	738,902,577	564.66	725,034,262	8.000	2024/9/5	0.88
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	25,500,000	2,808.71	716,223,048	2,776.67	708,053,268	3.733	2028/6/15	0.86
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000	407.85	715,786,373	397.90	698,323,503	3.650	2031/6/20	0.84
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000	2,143.34	681,582,649	2,175.10	691,684,930	10.000	2025/1/1	0.84

南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	97,200,000	678.14	659,155,415	683.65	664,508,111	8.250	2032/3/31	0.80
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	115,600,000	580.31	670,849,108	556.89	643,768,121	7.750	2031/5/29	0.78
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000	644.67	629,845,931	648.88	633,962,140	8.500	2037/1/31	0.77
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000	2,718.72	655,213,266	2,582.83	622,463,882	2.500	2026/7/25	0.75
タイ	国債証券	THAIGB 2.875% 12/17/28	163,200,000	383.17	625,346,722	377.98	616,877,836	2.875	2028/12/17	0.75
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	105,950,000	574.34	608,523,102	564.79	598,397,153	8.000	2023/12/7	0.72
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	608.08	609,606,092	592.80	594,286,384	10.000	2024/12/5	0.72
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	108,500,000	564.97	613,002,594	538.85	584,661,382	7.750	2042/11/13	0.71
インドネシア	国債証券	INDOGB 7% 09/15/30	69,000,000,000	0.84	586,497,510	0.83	576,991,593	7.000	2030/9/15	0.70
タイ	国債証券	THAIGB 1.45% 12/17/24	160,000,000	359.38	575,017,383	357.96	572,746,736	1.450	2024/12/17	0.69
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	22,600,000	2,732.88	617,631,956	2,520.59	569,653,719	2.750	2029/10/25	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	96.64
合計	96.64

(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。

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	16,863,328,359	16.50
	台湾	15,463,508,860	15.13
	インド	11,612,029,916	11.36
	中国	11,576,789,323	11.33
	韓国	11,334,290,240	11.09
	ブラジル	4,766,612,224	4.66
	サウジアラビア	3,633,361,071	3.56

	南アフリカ	3,269,836,237	3.20
	メキシコ	1,872,146,437	1.83
	ロシア	1,786,565,635	1.75
	タイ	1,727,279,540	1.69
	インドネシア	1,668,009,253	1.63
	マレーシア	1,353,614,376	1.32
	アラブ首長国連邦	1,185,490,140	1.16
	香港	1,090,480,115	1.07
	カタール	825,569,627	0.81
	フィリピン	715,963,641	0.70
	クウェート	645,947,417	0.63
	ポーランド	591,372,669	0.58
	バミューダ	506,601,526	0.50
	チリ	411,833,305	0.40
	アメリカ	348,837,916	0.34
	ギリシャ	232,458,666	0.23
	トルコ	231,681,777	0.23
	ハンガリー	206,951,582	0.20
	コロンビア	199,345,668	0.20
	チェコ	144,095,661	0.14
	オランダ	71,619,219	0.07
	ルクセンブルク	70,968,711	0.07
	キプロス	68,503,910	0.07
	エジプト	64,083,259	0.06
	ジャージー	55,153,675	0.05
	マン島	43,840,364	0.04
	シンガポール	24,886,541	0.02
	ペルー	19,053,987	0.02
	英ヴァージン諸島	8,168,599	0.01
	小計	94,690,279,446	92.65
投資信託受益証券	ブラジル	171,759,960	0.17
	メキシコ	37,000,161	0.04
	小計	208,760,121	0.20
投資証券	南アフリカ	48,536,345	0.05
	メキシコ	38,967,363	0.04
	小計	87,503,708	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	7,215,809,428	7.06
合計(純資産総額)		102,202,352,703	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	7,130,806,578	6.98

(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	—	24,563,056	0.02
	売建	—	59,209,555	△0.06

(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	2,805,389	2,519.91	7,069,337,903	2,492.64	6,992,846,158	6.84
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	626,300	6,660.63	4,171,554,347	6,270.96	3,927,502,248	3.84
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	520,395	6,768.49	3,522,291,380	6,902.40	3,591,974,448	3.51
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	1,652,688	2,320.86	3,835,661,480	1,557.38	2,573,874,806	2.52
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	444,200	3,991.12	1,772,857,405	2,517.25	1,118,166,004	1.09
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	309,735	3,908.63	1,210,641,062	3,540.12	1,096,499,843	1.07
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	370,852	2,700.87	1,001,624,896	2,626.63	974,090,989	0.95
ブラジル	株式	VALE SA	素材	467,987	1,517.82	710,323,582	2,069.03	968,282,682	0.95
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	218,211	4,418.49	964,164,823	4,079.08	890,100,562	0.87
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,385,620	77.20	801,809,330	85.04	883,219,089	0.86
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	173,804	4,056.51	705,037,986	4,477.68	778,239,824	0.76
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	60,303	10,464.00	631,010,592	11,808.00	712,057,824	0.70
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	187,327	4,559.48	854,113,710	3,722.09	697,248,422	0.68
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	563,039	1,219.15	686,430,404	1,131.57	637,122,264	0.62

サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	130,773	4,534.94	593,049,016	4,787.91	626,130,662	0.61
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	695,000	831.19	577,682,610	896.27	622,910,430	0.61
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	1,447,248	444.58	643,428,594	425.07	615,182,720	0.60
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	88,687	6,336.00	561,920,832	6,345.59	562,772,227	0.55
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	102,286	5,435.73	555,999,442	5,457.16	558,191,323	0.55
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	30,081	18,676.34	561,803,179	17,691.86	532,188,856	0.52
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	236,442	2,066.95	488,713,792	2,094.71	495,278,604	0.48
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	214,130	2,323.92	497,621,369	2,163.77	463,329,569	0.45
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,265,515	62.56	391,981,270	67.73	424,414,708	0.42
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	655,305	1,136.31	744,635,326	644.76	422,520,350	0.41
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	544,440	597.30	325,195,880	762.32	415,039,787	0.41
中国	株式	CHINA MERCHANTS BANK-H	銀行	429,923	928.07	398,999,714	958.39	412,034,764	0.40
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	6,307,600	62.42	393,781,351	65.20	411,287,058	0.40
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	13,595	40,080.00	544,887,600	30,192.00	410,460,240	0.40
アラブ首長国連邦	株式	EMIRATES TELECOM GROUP CO	電気通信サービス	375,599	936.99	351,935,231	1,048.65	393,872,943	0.39
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	8,801,200	40.67	357,966,807	44.66	393,112,639	0.38

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	5.08
		素材	8.57
		資本財	2.89
		商業・専門サービス	0.10
		運輸	1.77
		自動車・自動車部品	3.10
		耐久消費財・アパレル	1.49
		消費者サービス	0.91
		メディア・娯楽	6.58
		小売	6.13
		食品・生活必需品小売り	1.16

		食品・飲料・タバコ	3.50
		家庭用品・パーソナル用品	0.77
		ヘルスケア機器・サービス	1.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.66
		銀行	14.54
		各種金融	2.29
		保険	2.57
		不動産	1.85
		ソフトウェア・サービス	2.60
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.00
		電気通信サービス	2.98
		公益事業	2.14
		半導体・半導体製造装置	9.99
		小計	92.65
投資信託受益証券	—	—	0.20
投資証券	—	—	0.09
合計			92.94

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	1,037	アメリカドル	63,152,893	7,297,316,786	61,711,870	7,130,806,578	6.98

(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	212,588.20	24,576,648	24,563,056	0.02
	アメリカドル	売建	500,000.00	57,780,000	57,773,200	△0.06
	ブラジルレアル	売建	64,062.13	1,470,648	1,436,355	△0.00

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

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

≪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：2009年1月16日
作成基準日：2022年2月28日

基準価額・純資産の推移

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	27,671円
純資産総額	1,293.98億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年1月	0円
2019年1月	0円
2020年1月	0円
2021年1月	0円
2022年1月	0円
設定来分配金合計額	60円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	30.6%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	1.5%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.2%
外国債券インデックスマザーファンド	29.7%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.2%
		T 2% 08/15/51	アメリカ	国債	-	2.000%	2051/08/15	0.2%
新興国債券インデックスマザーファンド	15.1%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.4%
		BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.3%
新興国株式インデックスマザーファンド	14.6%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	1.0%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.6%
国内株式インデックスマザーファンド	5.1%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	3.7%	第141回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.100%	2024/09/20	0.0%
		第148回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/06/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

＜申込コース＞

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

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

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

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

＜申込価額＞

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

＜申込手数料＞

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

＜申込代金の支払い＞

販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

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、取引所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、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜解約価額＞

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

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

＜一部解約代金の支払い＞

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

＜受付不可日＞

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

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、取引所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、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

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

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

イ．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。

ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日のわが国の取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産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。(2009 年 1 月 16 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 1 月 21 日から翌年 1 月 20 日までとします。
ただし、第 1 計算期間は 2009 年 1 月 16 日から 2010 年 1 月 20 日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

・受益権の口数が 5 億口を下回ることとなった場合
・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
・やむを得ない事情が発生した場合

②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該

提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき
・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

４【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

②収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して５営業日までに支払いを開始します。

③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金

の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

④上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者が償還金について支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 13 期計算期間(2021 年 1 月 21 日から 2022 年 1 月 20 日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2022年3月18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　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界経済インデックスファンドの2021年1月21日から2022年1月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界経済インデックスファンドの2022年1月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる

十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【世界経済インデックスファンド】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 （2021年 1月20日現在）	第13期 （2022年 1月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	54,244	-
コール・ローン	1,059,406,955	1,626,523,296
親投資信託受益証券	81,864,274,672	127,071,222,378
未収入金	368,070,000	286,740,000
流動資産合計	83,291,805,871	128,984,485,674
資産合計	83,291,805,871	128,984,485,674
負債の部		
流動負債		
未払解約金	304,937,633	155,568,060
未払受託者報酬	20,954,168	32,663,709
未払委託者報酬	188,587,520	293,973,314
未払利息	719	2,438
その他未払費用	1,872,616	2,064,331
流動負債合計	516,352,656	484,271,852
負債合計	516,352,656	484,271,852
純資産の部		
元本等		
元本	31,955,196,547	45,363,574,975
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	50,820,256,668	83,136,638,847
（分配準備積立金）	11,452,082,551	17,320,038,513
元本等合計	82,775,453,215	128,500,213,822
純資産合計	82,775,453,215	128,500,213,822
負債純資産合計	83,291,805,871	128,984,485,674

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期 自　2020年1月21日 至　2021年1月20日	第13期 自　2021年1月21日 至　2022年1月20日
営業収益		
受取利息	6,732	6,854
有価証券売買等損益	5,760,520,776	8,825,977,706
営業収益合計	5,760,527,508	8,825,984,560
営業費用		
支払利息	433,592	554,032
受託者報酬	38,780,963	57,958,786
委託者報酬	349,028,649	521,628,965
その他費用	1,874,264	2,064,331
営業費用合計	390,117,468	582,206,114
営業利益又は営業損失（△）	5,370,410,040	8,243,778,446
経常利益又は経常損失（△）	5,370,410,040	8,243,778,446
当期純利益又は当期純損失（△）	5,370,410,040	8,243,778,446
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（△）	△333,081,542	816,319,140
期首剰余金又は期首欠損金（△）	40,493,108,163	50,820,256,668
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,224,128,540	33,718,601,914
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,224,128,540	33,718,601,914
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,600,471,617	8,829,679,041
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,600,471,617	8,829,679,041
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	50,820,256,668	83,136,638,847

（3）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第12期 （2021年 1月 20日現在）	第13期 （2022年 1月 20日現在）
1．計算期間の末日における受益権の総数	31,955,196,547口	45,363,574,975口
2．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.5904円 （1万口当たり純資産額） （25,904円）	1口当たり純資産額 2.8327円 （1万口当たり純資産額） （28,327円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第12期
自 2020年 1月 21日
至 2021年 1月 20日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,529,008,680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	4,174,482,902円
収益調整金額	C	39,368,174,117円
分配準備積立金額	D	5,748,590,969円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	50,820,256,668円
当ファンドの期末残存口数	F	31,955,196,547口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	15,903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

第13期
自 2021年 1月 21日
至 2022年 1月 20日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,134,420,830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	5,293,038,476円
収益調整金額	C	65,816,600,334円
分配準備積立金額	D	9,892,579,207円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	83,136,638,847円
当ファンドの期末残存口数	F	45,363,574,975口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	18,326円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第13期 自 2021年 1月 21日 至 2022年 1月 20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第13期 （2022年 1月 20日現在）

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第12期 自 2020年 1月 21日 至 2021年 1月 20日	第13期 自 2021年 1月 21日 至 2022年 1月 20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	28,106,957,352円	31,955,196,547円
期中追加設定元本額	10,639,014,321円	18,862,758,575円
期中一部解約元本額	6,790,775,126円	5,454,380,147円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 (2021年 1月 20日現在)	第13期 (2022年 1月 20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	5,676,261,043	8,721,299,120
合計	5,676,261,043	8,721,299,120

(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	5,241,696,474	19,236,501,889	
	国内株式インデックス　マザーファンド	3,488,644,943	6,596,329,858	
	外国株式インデックス　マザーファンド	9,577,066,256	39,558,072,170	
	国内債券インデックス　マザーファンド	3,326,552,717	4,669,149,393	
	外国債券インデックス　マザーファンド	12,400,849,452	37,883,354,990	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	10,932,053,540	19,127,814,078	
合計		44,966,863,382	127,071,222,378	

(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。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月 20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	515,724,210
国債証券	542,547,283,100
地方債証券	35,532,536,388
特殊債券	39,212,798,662
社債券	29,983,332,020
未収利息	1,034,521,342
前払費用	14,206,093
流動資産合計	648,840,401,815
資産合計	648,840,401,815
負債の部	
流動負債	
未払解約金	389,603,473
未払利息	773

流動負債合計	389,604,246
負債合計	389,604,246
純資産の部	
元本等	
元本	462,000,831,762
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	186,449,965,807
元本等合計	648,450,797,569
純資産合計	648,450,797,569
負債純資産合計	648,840,401,815

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
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 1月20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	462,000,831,762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 100,677,000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 1.4036円
		(1万口当たり純資産額) (14,036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 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性

	リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月 20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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 1月 20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月 21日
期首元本額	431,157,941,659円
期中追加設定元本額	66,787,655,439円
期中一部解約元本額	35,944,765,336円
期末元本額	462,000,831,762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
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,922,731,130円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	17,145,897円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	20,053,396,007円
世界経済インデックスファンド	3,326,552,717円
ＤＣマイセレクション２５	25,206,785,211円
ＤＣマイセレクション５０	28,693,332,315円
ＤＣマイセレクション７５	8,417,033,589円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	443,229,994円

ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	92,995,206,193 円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	68,158,829,575 円
ＤＣマイセレクションＳ２５	12,233,971,690 円
ＤＣマイセレクションＳ５０	13,670,894,740 円
ＤＣマイセレクションＳ７５	2,937,613,546 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	884,907,016 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	2,079,681,432 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	762,802,847 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,188,517,405 円
日本債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	8,508,675 円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,561,112 円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	32,884,644 円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	9,687,330 円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,065,314 円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	100,447,098 円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	143,873,019 円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	34,399,011 円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	33,251,587 円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,129,392,113 円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	780,768,188 円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,298,348,050 円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	128,476,574 円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	80,708,395 円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,054,974,018 円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,165,136,913 円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,492,777,170 円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	145,270,376 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	5,819,118,506 円
日本債券ファンド・シリーズ１	14,983,744,748 円
分散投資コア戦略ファンドＡ	25,923,818,430 円
分散投資コア戦略ファンドＳ	32,971,011,995 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	147,276,557 円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,308,708,904 円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	62,889,699 円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,787,715 円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	58,185,006 円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	32,116,270 円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	61,315,746 円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	101,463,607 円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	8,214,116 円
グローバル経済コア	227,435,681 円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	27,173,499 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	14,846,995 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	10,638,408 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	4,740,525 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	1,601,884 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	1,034,565 円
ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	81,142,630,576 円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	76,106,868 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	9,657,995 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）	333,925,336 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022 年 1 月 20 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

国債証券	△4,582,662,500
地方債証券	△205,143,230
特殊債券	△202,109,302
社債券	△89,847,140
合計	△5,079,762,172

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第４２１回利付国債（２年）	590,000,000	591,185,900	
	第４２２回利付国債（２年）	40,000,000	40,084,000	
	第４２３回利付国債（２年）	1,310,000,000	1,311,480,300	
	第４２４回利付国債（２年）	2,070,000,000	2,072,504,700	
	第４２５回利付国債（２年）	2,870,000,000	2,873,702,300	
	第４２６回利付国債（２年）	620,000,000	620,799,800	
	第４２７回利付国債（２年）	3,870,000,000	3,875,301,900	
	第４２８回利付国債（２年）	230,000,000	230,333,500	
	第４２９回利付国債（２年）	950,000,000	951,444,000	
	第４３０回利付国債（２年）	2,120,000,000	2,123,201,200	
	第１３５回利付国債（５年）	4,080,000,000	4,088,976,000	
	第１３６回利付国債（５年）	4,400,000,000	4,411,484,000	
	第１３７回利付国債（５年）	6,760,000,000	6,780,820,800	
	第１３８回利付国債（５年）	6,890,000,000	6,913,701,600	
	第１３９回利付国債（５年）	5,690,000,000	5,712,134,100	
	第１４０回利付国債（５年）	6,300,000,000	6,326,586,000	
	第１４１回利付国債（５年）	7,250,000,000	7,283,785,000	
	第１４２回利付国債（５年）	5,380,000,000	5,407,438,000	
	第１４３回利付国債（５年）	4,800,000,000	4,826,592,000	
	第１４４回利付国債（５年）	6,310,000,000	6,347,733,800	

	第１４５回利付国債（５年）	7,410,000,000	7,456,238,400	
	第１４６回利付国債（５年）	3,150,000,000	3,169,750,500	
	第１４７回利付国債（５年）	4,420,000,000	4,431,050,000	
	第１４８回利付国債（５年）	8,990,000,000	9,011,845,700	
	第１４９回利付国債（５年）	4,860,000,000	4,870,206,000	
	第１回利付国債（４０年）	400,000,000	567,928,000	
	第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,555,851,800	
	第３回利付国債（４０年）	550,000,000	761,981,000	
	第４回利付国債（４０年）	1,200,000,000	1,670,268,000	
	第５回利付国債（４０年）	1,070,000,000	1,441,504,000	
	第６回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,674,603,000	
	第７回利付国債（４０年）	1,440,000,000	1,842,163,200	
	第８回利付国債（４０年）	1,230,000,000	1,473,601,500	
	第９回利付国債（４０年）	2,050,000,000	1,847,357,500	
	第１０回利付国債（４０年）	2,200,000,000	2,317,590,000	
	第１１回利付国債（４０年）	1,790,000,000	1,828,449,200	
	第１２回利付国債（４０年）	1,450,000,000	1,340,757,000	
	第１３回利付国債（４０年）	2,140,000,000	1,972,480,800	
	第１４回利付国債（４０年）	1,340,000,000	1,315,732,600	
	第３２８回利付国債（１０年）	5,940,000,000	5,987,520,000	
	第３２９回利付国債（１０年）	4,410,000,000	4,464,816,300	
	第３３０回利付国債（１０年）	3,910,000,000	3,967,281,500	
	第３３１回利付国債（１０年）	900,000,000	910,188,000	
	第３３２回利付国債（１０年）	4,800,000,000	4,862,016,000	
	第３３３回利付国債（１０年）	3,030,000,000	3,074,207,700	
	第３３４回利付国債（１０年）	4,260,000,000	4,329,438,000	
	第３３５回利付国債（１０年）	2,410,000,000	2,446,969,400	
	第３３６回利付国債（１０年）	950,000,000	965,941,000	
	第３３７回利付国債（１０年）	2,800,000,000	2,830,632,000	
	第３３８回利付国債（１０年）	4,560,000,000	4,627,807,200	
	第３３９回利付国債（１０年）	4,750,000,000	4,826,285,000	
	第３４０回利付国債（１０年）	4,830,000,000	4,913,365,800	
	第３４１回利付国債（１０年）	5,340,000,000	5,416,415,400	
	第３４２回利付国債（１０年）	5,050,000,000	5,082,623,000	
	第３４３回利付国債（１０年）	2,670,000,000	2,687,702,100	
	第３４４回利付国債（１０年）	6,000,000,000	6,040,620,000	

	第３４５回利付国債（１０年）	3,740,000,000	3,764,833,600	
	第３４６回利付国債（１０年）	6,250,000,000	6,291,937,500	
	第３４７回利付国債（１０年）	3,880,000,000	3,906,267,600	
	第３４８回利付国債（１０年）	5,090,000,000	5,124,612,000	
	第３４９回利付国債（１０年）	5,070,000,000	5,104,476,000	
	第３５０回利付国債（１０年）	7,830,000,000	7,883,009,100	代用有価証券 100,000,000円
	第３５１回利付国債（１０年）	5,110,000,000	5,144,390,300	
	第３５２回利付国債（１０年）	4,510,000,000	4,540,036,600	
	第３５３回利付国債（１０年）	4,300,000,000	4,328,208,000	
	第３５４回利付国債（１０年）	4,690,000,000	4,720,156,700	
	第３５５回利付国債（１０年）	4,750,000,000	4,778,072,500	
	第３５６回利付国債（１０年）	5,040,000,000	5,066,964,000	
	第３５７回利付国債（１０年）	2,500,000,000	2,511,825,000	
	第３５８回利付国債（１０年）	3,290,000,000	3,303,357,400	
	第３５９回利付国債（１０年）	3,430,000,000	3,441,456,200	
	第３６０回利付国債（１０年）	5,210,000,000	5,223,441,800	
	第３６１回利付国債（１０年）	4,640,000,000	4,648,166,400	
	第３６２回利付国債（１０年）	3,850,000,000	3,851,732,500	
	第３６３回利付国債（１０年）	7,360,000,000	7,349,696,000	
	第３６４回利付国債（１０年）	4,210,000,000	4,197,917,300	
	第１回利付国債（３０年）	110,000,000	133,244,100	
	第２回利付国債（３０年）	160,000,000	190,342,400	
	第３回利付国債（３０年）	120,000,000	142,327,200	
	第４回利付国債（３０年）	110,000,000	137,318,500	
	第５回利付国債（３０年）	50,000,000	59,701,500	
	第６回利付国債（３０年）	350,000,000	427,322,000	
	第７回利付国債（３０年）	180,000,000	219,463,200	
	第８回利付国債（３０年）	350,000,000	410,697,000	
	第９回利付国債（３０年）	240,000,000	271,480,800	
	第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	175,908,800	
	第１１回利付国債（３０年）	260,000,000	303,677,400	
	第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	231,142,600	
	第１３回利付国債（３０年）	400,000,000	483,208,000	
	第１４回利付国債（３０年）	800,000,000	1,007,120,000	
	第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	433,387,800	

	第１６回利付国債（３０年）	200,000,000	255,704,000	
	第１７回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,461,098,000	
	第１８回利付国債（３０年）	345,000,000	435,100,200	
	第１９回利付国債（３０年）	530,000,000	670,110,800	
	第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	621,451,200	
	第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	635,670,000	
	第２２回利付国債（３０年）	420,000,000	546,982,800	
	第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	561,451,000	
	第２４回利付国債（３０年）	380,000,000	497,416,200	
	第２５回利付国債（３０年）	350,000,000	449,274,000	
	第２６回利付国債（３０年）	1,140,000,000	1,482,809,400	
	第２７回利付国債（３０年）	1,920,000,000	2,538,604,800	
	第２８回利付国債（３０年）	2,140,000,000	2,843,653,400	
	第２９回利付国債（３０年）	1,670,000,000	2,202,078,700	
	第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,313,690,900	
	第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,424,291,000	
	第３２回利付国債（３０年）	1,560,000,000	2,054,816,400	
	第３３回利付国債（３０年）	1,820,000,000	2,307,669,000	
	第３４回利付国債（３０年）	1,795,000,000	2,346,980,450	
	第３５回利付国債（３０年）	2,300,000,000	2,930,752,000	
	第３６回利付国債（３０年）	2,210,000,000	2,827,429,800	
	第３７回利付国債（３０年）	2,190,000,000	2,769,386,400	
	第３８回利付国債（３０年）	1,500,000,000	1,871,325,000	
	第３９回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,599,607,800	
	第４０回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,802,376,000	
	第４１回利付国債（３０年）	1,130,000,000	1,393,662,900	
	第４２回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,654,163,000	
	第４３回利付国債（３０年）	1,320,000,000	1,630,992,000	
	第４４回利付国債（３０年）	1,290,000,000	1,595,368,800	
	第４５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,721,865,600	
	第４６回利付国債（３０年）	1,850,000,000	2,213,303,000	
	第４７回利付国債（３０年）	1,560,000,000	1,901,686,800	
	第４８回利付国債（３０年）	1,780,000,000	2,094,597,200	
	第４９回利付国債（３０年）	1,710,000,000	2,012,909,400	
	第５０回利付国債（３０年）	1,790,000,000	1,867,507,000	
	第５１回利付国債（３０年）	1,660,000,000	1,542,455,400	

	第５２回利付国債（３０年）	1,740,000,000	1,693,507,200	
	第５３回利付国債（３０年）	1,320,000,000	1,312,885,200	
	第５４回利付国債（３０年）	1,910,000,000	1,986,973,000	
	第５５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,496,894,400	
	第５６回利付国債（３０年）	1,680,000,000	1,745,016,000	
	第５７回利付国債（３０年）	1,610,000,000	1,670,954,600	
	第５８回利付国債（３０年）	2,550,000,000	2,641,417,500	
	第５９回利付国債（３０年）	1,000,000,000	1,010,130,000	
	第６０回利付国債（３０年）	1,530,000,000	1,616,919,300	
	第６１回利付国債（３０年）	1,520,000,000	1,530,396,800	
	第６２回利付国債（３０年）	120,000,000	114,652,800	
	第６３回利付国債（３０年）	1,260,000,000	1,169,028,000	
	第６４回利付国債（３０年）	2,360,000,000	2,185,784,800	
	第６５回利付国債（３０年）	1,590,000,000	1,470,034,500	
	第６６回利付国債（３０年）	1,030,000,000	952,832,400	
	第６７回利付国債（３０年）	2,230,000,000	2,169,433,200	
	第６８回利付国債（３０年）	1,640,000,000	1,597,032,000	
	第６９回利付国債（３０年）	1,240,000,000	1,238,499,600	
	第７０回利付国債（３０年）	1,920,000,000	1,915,353,600	
	第７１回利付国債（３０年）	1,430,000,000	1,426,510,800	
	第７２回利付国債（３０年）	1,010,000,000	1,006,283,200	
	第６１回利付国債（２０年）	240,000,000	243,033,600	
	第６２回利付国債（２０年）	320,000,000	323,977,600	
	第６３回利付国債（２０年）	200,000,000	205,310,000	
	第６４回利付国債（２０年）	320,000,000	330,550,400	
	第６５回利付国債（２０年）	220,000,000	228,320,400	
	第６６回利付国債（２０年）	330,000,000	341,847,000	
	第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	135,536,700	
	第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	199,325,200	
	第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	408,294,900	
	第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	423,860,000	
	第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	210,964,000	
	第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	666,470,700	
	第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	381,744,000	
	第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	212,664,000	
	第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	138,908,900	

	第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	286,794,000	
	第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	308,954,400	
	第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	181,418,900	
	第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	289,059,300	
	第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	236,282,200	
	第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	419,569,800	
	第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	647,694,000	
	第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	314,502,100	
	第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	507,867,900	
	第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	315,984,000	
	第８６回利付国債（２０年）	510,000,000	559,944,300	
	第８７回利付国債（２０年）	1,830,000,000	2,001,599,100	
	第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	463,528,800	
	第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	384,727,000	
	第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	695,923,200	
	第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	499,189,500	
	第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	972,206,400	
	第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	453,000,800	
	第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	677,130,500	
	第９５回利付国債（２０年）	610,000,000	686,841,700	
	第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,773,056,700	
	第９７回利付国債（２０年）	400,000,000	450,344,000	
	第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	492,883,600	
	第９９回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,451,443,500	
	第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	545,371,200	
	第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	821,191,800	
	第１０２回利付国債（２０年）	1,260,000,000	1,454,329,800	
	第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	459,124,000	
	第１０４回利付国債（２０年）	160,000,000	181,598,400	
	第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,345,105,600	
	第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	435,700,400	
	第１０７回利付国債（２０年）	260,000,000	297,637,600	
	第１０８回利付国債（２０年）	660,000,000	746,420,400	
	第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	590,304,000	
	第１１０回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,264,461,000	
	第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,126,470,700	

	第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	911,588,900	
	第１１３回利付国債（２０年）	2,020,000,000	2,339,685,200	
	第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,708,555,100	
	第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	819,252,000	
	第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,751,018,200	
	第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,260,414,000	
	第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	767,467,800	
	第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	607,427,700	
	第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,773,079,500	
	第１２１回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,737,105,000	
	第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,080,492,400	
	第１２３回利付国債（２０年）	1,870,000,000	2,205,234,900	
	第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	713,956,200	
	第１２５回利付国債（２０年）	1,820,000,000	2,168,839,400	
	第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	856,655,000	
	第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,187,708,400	
	第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,132,251,900	
	第１２９回利付国債（２０年）	890,000,000	1,030,575,500	
	第１３０回利付国債（２０年）	1,285,000,000	1,491,203,950	
	第１３１回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,150,920,000	
	第１３２回利付国債（２０年）	1,160,000,000	1,338,222,400	
	第１３３回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,431,006,600	
	第１３４回利付国債（２０年）	1,130,000,000	1,317,218,400	
	第１３５回利付国債（２０年）	1,030,000,000	1,190,340,100	
	第１３６回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,661,207,000	
	第１３７回利付国債（２０年）	1,090,000,000	1,262,536,100	
	第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	705,436,000	
	第１３９回利付国債（２０年）	730,000,000	838,069,200	
	第１４０回利付国債（２０年）	2,520,000,000	2,925,316,800	
	第１４１回利付国債（２０年）	1,600,000,000	1,861,264,000	
	第１４２回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,197,480,000	
	第１４３回利付国債（２０年）	1,800,000,000	2,078,460,000	
	第１４４回利付国債（２０年）	1,150,000,000	1,315,335,500	
	第１４５回利付国債（２０年）	3,155,000,000	3,685,008,450	
	第１４６回利付国債（２０年）	2,870,000,000	3,358,732,300	
	第１４７回利付国債（２０年）	2,510,000,000	2,913,758,600	

	第１４８回利付国債（２０年）	1,990,000,000	2,290,271,100	
	第１４９回利付国債（２０年）	2,880,000,000	3,319,315,200	
	第１５０回利付国債（２０年）	2,760,000,000	3,151,506,000	
	第１５１回利付国債（２０年）	2,395,000,000	2,677,921,350	
	第１５２回利付国債（２０年）	3,290,000,000	3,681,115,200	
	第１５３回利付国債（２０年）	2,440,000,000	2,763,470,800	
	第１５４回利付国債（２０年）	2,800,000,000	3,136,924,000	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,950,000,000	3,227,919,500	
	第１５６回利付国債（２０年）	2,310,000,000	2,336,611,200	
	第１５７回利付国債（２０年）	3,030,000,000	2,975,793,300	
	第１５８回利付国債（２０年）	2,530,000,000	2,588,341,800	
	第１５９回利付国債（２０年）	2,730,000,000	2,830,737,000	
	第１６０回利付国債（２０年）	2,300,000,000	2,415,874,000	
	第１６１回利付国債（２０年）	2,190,000,000	2,266,737,600	
	第１６２回利付国債（２０年）	1,050,000,000	1,085,752,500	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,060,000,000	2,128,000,600	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,660,000,000	1,686,460,400	
	第１６５回利付国債（２０年）	2,180,000,000	2,211,849,800	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,330,000,000	1,390,155,900	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,340,000,000	2,367,682,200	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,450,000,000	1,440,734,500	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,990,000,000	1,940,230,100	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,610,000,000	2,539,686,600	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,540,000,000	1,495,509,400	
	第１７２回利付国債（２０年）	2,520,000,000	2,486,307,600	
	第１７３回利付国債（２０年）	3,080,000,000	3,033,184,000	
	第１７４回利付国債（２０年）	2,480,000,000	2,437,641,600	
	第１７５回利付国債（２０年）	1,960,000,000	1,958,294,800	
	第１７６回利付国債（２０年）	3,350,000,000	3,341,223,000	
	第１７７回利付国債（２０年）	2,550,000,000	2,491,630,500	
	第１７８回利付国債（２０年）	1,690,000,000	1,680,958,500	
国債証券合計		512,720,000,000	542,547,283,100	
地方債証券	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	104,857,000	
	第５回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年））	100,000,000	99,398,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	106,284,000	

	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	130,691,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	129,211,000	
	第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	125,253,000	
	第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	124,616,000	
	第１６回東京都公募公債（２０年）	300,000,000	339,240,000	
	第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	113,629,000	
	第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	114,688,000	
	第１９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	98,920,000	
	第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	230,814,000	
	第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	230,382,000	
	第３３回東京都公募公債（５年）	200,000,000	199,998,000	
	第７１７回東京都公募公債	100,000,000	100,719,000	
	第７２０回東京都公募公債	100,000,000	101,217,000	
	第７２６回東京都公募公債	200,000,000	202,758,000	
	第７２８回東京都公募公債	100,000,000	101,225,000	
	第７５１回東京都公募公債	100,000,000	101,408,000	
	第７６５回東京都公募公債	100,000,000	100,792,000	
	第７７０回東京都公募公債	100,000,000	100,619,000	
	第７８１回東京都公募公債	300,000,000	301,242,000	
	第８００回東京都公募公債	200,000,000	198,980,000	
	平成２４年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	100,867,000	
	平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,819,000	
	平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	100,279,000	
	平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	100,910,000	
	平成３０年度第１４回北海道公募公債	200,000,000	201,030,000	
	第２９回１号宮城県公募公債（１０年）	100,000,000	101,180,000	
	第４回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	266,800,000	
	第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	114,435,000	
	第１５回神奈川県公募公債（２０年）	200,000,000	230,736,000	
	第１７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	116,676,000	
	第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	115,002,000	
	第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	113,193,000	
	第７８回神奈川県公募公債（５年）	200,000,000	199,974,000	
	第２０１回神奈川県公募公債	200,250,000	202,564,890	
	第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	202,570,000	
	第２１５回神奈川県公募公債	100,000,000	101,651,000	

	第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,723,000	
	第２２６回神奈川県公募公債	100,000,000	100,715,000	
	第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	100,619,000	
	第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	198,902,000	
	第６回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	230,852,000	
	第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	230,954,000	
	第１０回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	115,289,000	
	第３７１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,713,000	
	第３７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,317,000	
	第３７７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,268,000	
	第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,428,000	
	第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	153,071,720	
	第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,850,000	
	第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,840,000	
	第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	156,468,000	
	第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	199,788,000	
	第４３９回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	201,002,000	
	第４４０回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,522,000	
	第４６５回大阪府公募公債（１０年）	160,000,000	159,067,200	
	第４６８回大阪府公募公債（１０年）	182,000,000	180,760,580	
	第４６９回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	198,496,000	
	平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	115,550,000	
	平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	115,156,000	
	平成２５年度第７回京都府公募公債	100,000,000	101,314,000	
	平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	101,852,000	
	平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	98,992,000	
	平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	102,931,000	
	令和２年度第１２回京都府公募公債	140,500,000	139,883,205	
	第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	112,874,000	
	第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	101,779,000	
	第６回兵庫県公募公債（１５年）	200,000,000	216,168,000	
	第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	106,982,000	
	第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	106,920,000	
	第９回兵庫県公募公債（２０年）	400,000,000	465,380,000	

	平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	101,395,000	
	第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	101,792,000	
	令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	300,237,000	
	第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	118,913,000	
	第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	102,374,000	
	第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	115,290,000	
	第１８回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	114,032,000	
	平成２４年度第１０回静岡県公募公債	100,000,000	100,772,000	
	平成２６年度第３回静岡県公募公債	100,000,000	101,571,000	
	平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	100,673,000	
	平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	100,781,000	
	平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	100,737,000	
	平成２９年度第１４回静岡県公募公債（５年）	100,000,000	100,033,000	
	令和２年度第１１回静岡県公募公債	310,000,000	310,923,800	
	平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	115,789,000	
	平成２５年度第２回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,715,000	
	平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,489,000	
	平成２６年度第５回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	203,054,000	
	平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	101,466,000	
	平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,247,000	
	平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	201,486,000	
	平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	300,000,000	307,608,000	
	平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,569,000	
	平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	101,144,000	
	令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	199,120,000	
	令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,915,000	
	令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年）	200,000,000	197,746,000	
	平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	114,886,000	
	平成２１年度第１回広島県公募公債（２０年）	200,000,000	230,378,000	

	平成２５年度第４回広島県公募公債	100,000,000	101,222,000	
	平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	127,474,121	
	平成２９年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,584,000	
	令和２年度第７回広島県公募公債	390,000,000	391,368,900	
	第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	112,694,000	
	第５回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	113,862,000	
	第６回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	114,355,000	
	第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	106,009,000	
	第７回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	231,750,000	
	第８回埼玉県公募公債（１５年）	200,000,000	199,374,000	
	第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	230,736,000	
	第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	198,042,000	
	平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	101,404,000	
	平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	101,803,000	
	平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	100,302,000	
	平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	100,982,000	
	平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	100,675,000	
	令和２年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	99,655,000	
	令和２年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	99,517,000	
	令和３年度第８回埼玉県公募公債	150,000,000	149,020,500	
	平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	112,754,000	
	平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	113,393,000	
	平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	106,365,000	
	平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	116,707,000	
	平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	107,112,000	
	平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	129,498,000	
	平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	111,606,000	
	平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	101,783,000	
	平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	101,144,000	
	平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	102,676,000	
	令和２年度第１回福岡県公募公債	300,000,000	299,997,000	
	令和３年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	99,649,000	

	令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	98,615,000	
	第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	228,710,000	
	第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	115,335,000	
	第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	115,290,000	
	平成２５年度第５回千葉県公募公債	100,000,000	101,324,000	
	平成２５年度第８回千葉県公募公債	300,000,000	303,651,000	
	平成２５年度第９回千葉県公募公債	100,000,000	101,331,000	
	平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	101,297,000	
	平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	101,798,000	
	平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	100,302,000	
	平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	120,867,600	
	令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	298,317,000	
	令和２年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	99,871,000	
	令和３年度第１回長野県公募公債（１０年）	300,000,000	300,237,000	
	平成３０年度第３回茨城県公募公債	350,000,000	350,112,000	
	第１回群馬県公募公債（２０年）	200,000,000	228,892,000	
	平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	100,690,000	
	第１１９回共同発行市場公募地方債	400,000,000	403,460,000	
	第１２１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,705,000	
	第１２５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,584,000	
	第１２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,180,000	
	第１２８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,198,000	
	第１３０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,020,000	
	第１３１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,360,000	
	第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,239,000	
	第１３４回共同発行市場公募地方債	112,000,000	113,739,360	
	第１３５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,575,000	
	第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,508,000	
	第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,439,000	
	第１４０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,816,000	
	第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,580,000	
	第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,622,000	
	第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	127,788,870	
	第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,869,000	
	第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,354,000	

	第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,278,000	
	第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,494,000	
	第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,274,000	
	第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,736,000	
	第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,127,000	
	第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,723,000	
	第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,962,000	
	第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,298,000	
	第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,968,392	
	第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,746,000	
	第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,611,000	
	第２１９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,498,000	
	平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	100,782,000	
	第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	232,016,000	
	第１５回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	98,537,000	
	第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	298,035,000	
	第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	103,446,000	
	平成２５年度第８回大阪市公募公債	100,000,000	101,536,000	
	令和３年度第２回大阪市公募公債	200,000,000	199,398,000	
	第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	127,918,000	
	第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	132,711,000	
	第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	113,531,000	
	第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	123,676,000	
	第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	100,872,000	
	第５１２回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	299,874,000	
	平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	201,448,000	
	平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	133,363,200	
	平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	228,878,000	
	平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	116,611,000	
	平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	115,509,000	
	令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	97,535,000	
	令和３年度第６回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	98,753,000	
	第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	107,373,000	
	第２０回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	345,060,000	

	平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	100,697,000	
	平成２９年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	100,875,000	
	平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	100,625,000	
	平成３０年度第４回横浜市公募公債	200,000,000	202,472,000	
	第３０回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	225,872,000	
	令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	299,997,000	
	令和３年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	99,698,000	
	平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	107,258,000	
	平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	101,224,000	
	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	114,438,000	
	第８９回川崎市公募公債	100,000,000	100,662,000	
	第９３回川崎市公募公債	100,000,000	99,486,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,275,000	
	平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	101,832,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	100,254,000	
	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	115,160,000	
	平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	114,236,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	202,930,000	
	平成３０年度第５回福岡市公募公債（５年）	200,000,000	200,064,000	
	平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	100,000,000	101,241,000	
	平成３０年度第１０回福岡市公募公債（５年）	100,000,000	100,019,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	152,071,500	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	101,306,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	105,723,450	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	171,433,100	
	令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	548,674,500	
	令和２年度第３回広島市公募公債（５年）	200,000,000	200,074,000	
	令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	198,958,000	
	平成２５年度第４回福井県公募公債	100,000,000	101,559,000	
	平成２４年度第１回徳島県公募公債	100,000,000	100,784,000	
	平成２４年度第２回岡山県公募公債（１０年）	150,000,000	151,189,500	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	201,936,000	

	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	112,554,000	
地方債証券合計		34,011,680,000	35,532,536,388	
特殊債券	第２回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	103,311,720	
	第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	413,206,200	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	309,381,000	
	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,344,000	
	第１１９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,946,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	94,591,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	127,044,000	
	第２７回道路債券	400,000,000	420,696,000	
	第２８回道路債券	200,000,000	257,750,000	
	第３３回道路債券	200,000,000	261,548,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,863,000	
	第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	148,515,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,677,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	106,941,000	
	第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,328,000	
	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	140,809,000	
	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	230,608,000	
	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	232,760,000	
	第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,453,000	
	第１０２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	604,530,000	
	第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	907,308,000	
	第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,187,000	
	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	129,032,000	
	第１１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,546,000	
	第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,205,000	
	第１１８回日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,445,000	

	債券			
	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	117,246,000	
	第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,962,000	
	第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,313,000	
	第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	130,465,000	
	第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	221,748,000	
	第１８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,131,000	
	第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,751,000	
	第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,572,000	
	第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	612,678,000	
	第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	302,000,000	304,129,100	
	第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	628,000,000	633,294,040	
	第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,588,000	
	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	150,042,400	
	第２０２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,270,000	
	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	269,183,634	
	第２０７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,742,000	
	第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,618,000	
	第２０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	422,000,000	428,435,500	
	第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,420,000	
	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	228,024,000	
	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	103,561,620	
	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	101,580,000	
	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	101,530,000	
	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	226,664,000	

	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	101,510,000	
	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	101,381,000	
	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	302,907,000	
	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	110,498,000	
	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	222,540,000	
	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	202,496,000	
	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	100,553,000	
	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	93,540,000	
	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	106,952,920	
	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	205,764,650	
	第３０６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,513,000	
	第３０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,992,000	
	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	100,592,000	
	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	120,978,000	
	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	200,996,000	
	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	307,428,000	
	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	216,084,360	
	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	99,334,000	
	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	99,197,000	
	第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	371,676,000	
	第３回公営企業債券（２０年）	210,000,000	212,484,300	
	第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	107,236,000	
	第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	387,228,000	
	第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	104,734,000	
	第７回公営企業債券（３０年）	200,000,000	259,296,000	
	第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	41,937,200	
	第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	127,719,000	

	第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	231,062,000	
	第１０回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	226,734,000	
	第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年）	200,000,000	191,962,000	
	第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	231,158,000	
	第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	114,818,000	
	第３４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	500,000,000	575,080,000	
	第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,892,000	
	第４６回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,572,000	
	第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,694,000	
	第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,817,000	
	第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,330,000	
	第５４回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,310,400	
	第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,756,000	
	第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,395,000	
	第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,580,000	
	第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,317,000	
	第６７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,425,000	
	第６９回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,437,000	
	第７６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,606,000	
	Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,077,000	
	第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,455,000	
	第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,041,000	
	第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,232,000	
	第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,344,000	
	第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,234,920	
	Ｆ９５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,023,000	
	第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,603,000	
	第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,585,000	
	第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,891,000	
	Ｆ１０７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,335,000	
	第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	157,422,720	
	第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,970,000	

	第１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,138,000	
	第１２０回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,301,000	
	Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,785,000	
	Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,432,000	
	Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,380,000	
	Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,537,000	
	第７回阪神高速道路債券	100,000,000	106,746,000	
	第２２回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,950,000	
	第１９回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,858,000	
	第４回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	115,494,000	
	第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	117,846,000	
	第２５回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	201,816,000	
	第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,051,660	
	第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,604,000	
	第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	210,426,300	
	第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	188,731,620	
	第７７回株式会社日本政策金融公庫社債	400,000,000	399,948,000	
	第８７回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,896,000	
	第８８回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,950,000	
	第１１７回都市再生債券	200,000,000	210,668,000	
	第１５９回都市再生債券	200,000,000	170,212,000	
	第１６１回都市再生債券	100,000,000	93,145,000	
	第１７１回都市再生債券	200,000,000	198,598,000	
	第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	106,377,000	
	第３４４回東京交通債券	100,000,000	101,704,000	
	第３４６回東京交通債券	20,000,000	20,292,400	
	第６２回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,916,000	
	第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,738,000	10,869,110	
	第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,071,000	11,246,143	
	第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,233,000	11,450,133	
	第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	145,263,000	144,898,389	
	第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	103,812,000	103,636,557	
	第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,099,000	11,294,342	

	第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,082,000	12,367,135	
	第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	185,895,000	185,132,830	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	19,936,000	20,013,750	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,996,000	12,269,748	
	第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	207,495,000	206,401,501	
	第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	74,119,000	73,929,255	
	第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,459,000	10,580,010	
	第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,408,000	12,734,082	
	第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	244,845,000	244,115,361	
	第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	10,636,000	10,760,441	
	第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	169,216,000	168,825,111	
	第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	12,521,000	12,888,741	
	第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,841,000	
	第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,442,000	17,323,620	
	第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,796,000	17,749,508	
	第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,590,000	19,769,535	
	第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,421,000	21,611,340	
	第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,641,000	24,103,835	
	第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,995,000	24,438,856	
	第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,684,000	51,629,868	
	第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,890,000	11,013,710	
	第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,993,000	23,166,326	
	第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,099,000	11,264,264	
	第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,696,000	10,839,647	
	第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,547,000	23,744,020	
	第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,953,000	9,992,513	
	第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,269,000	23,487,782	
	第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,089,000	22,183,519	
	第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,003,000	12,344,005	
	第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,824,000	46,896,213	
	第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,509,000	24,627,793	
	第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,707,000	11,977,197	

	第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,265,000	33,868,570	
	第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,402,000	32,944,466	
	第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,273,000	33,896,331	
	第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,410,000	75,933,470	
	第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,256,000	83,632,369	
	第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,134,000	42,823,373	
	第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,487,000	43,539,361	
	第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,632,000	43,743,575	
	第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,360,000	38,055,466	
	第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,754,000	37,155,914	
	第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,381,000	43,515,018	
	第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	175,596,000	
	第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,591,000	112,839,079	
	第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	146,876,000	152,629,132	
	第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,037,000	43,614,228	
	第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,281,000	44,933,468	
	第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,267,000	45,834,494	
	第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,566,000	
	第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,617,000	144,518,952	
	第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,974,000	49,465,031	
	第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,564,000	103,023,795	
	第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,970,000	57,523,167	
	第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,806,000	61,295,169	
	第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,401,000	61,175,307	
	第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,957,000	190,189,463	
	第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	123,990,000	128,053,152	
	第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,979,000	61,820,955	
	第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,938,000	66,977,053	
	第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,333,000	71,372,946	
	第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,760,000	76,978,766	
	第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,513,000	76,567,324	
	第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,800,000	77,197,824	
	第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債	77,146,000	77,881,201	

	券			
	第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,852,000	78,474,816	
	第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,535,000	80,137,875	
	第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,034,000	80,731,896	
	第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,868,000	80,348,805	
	第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,117,000	80,596,099	
	第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,712,000	81,235,820	
	第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	163,500,000	164,207,955	
	第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,708,000	81,177,720	
	第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,848,000	166,198,105	
	第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,107,000	82,590,610	
	第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,496,000	165,203,332	
	第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,114,000	83,607,697	
	第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,178,000	167,843,368	
	第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,188,000	168,838,887	
	第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	127,787,000	
	第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,302,000	86,091,043	
	第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,909,000	85,873,566	
	第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,175,000	85,450,115	
	第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,798,000	174,626,697	
	第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,604,000	87,434,048	
	第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,235,000	87,188,765	
	第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,150,000	175,815,315	
	第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,255,000	88,456,167	
	第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	270,063,000	266,295,621	
	第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債	181,108,000	178,548,943	

	券			
	第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,743,000	91,741,165	
	第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,424,000	92,170,758	
	第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,440,000	189,860,556	
	第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,746,000	95,836,958	
	第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,918,000	192,065,776	
	第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,816,000	192,621,255	
	第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,455,000	96,597,753	
	第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,326,000	194,393,159	
	第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,486,000	195,357,297	
	第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,897,000	98,241,597	
	第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,640,000	98,306,596	
	第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	296,463,000	295,428,344	
	第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,077,000	98,871,910	
	第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,455,000	
	第３２０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,773,000	
	第６２回日本学生支援債券	100,000,000	99,983,000	
	第６４回日本学生支援債券	300,000,000	299,931,000	
	第６５回日本学生支援債券	200,000,000	199,948,000	
	第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	106,873,000	
	い第８２３号商工債	200,000,000	200,424,000	
	い第８２９号商工債	200,000,000	200,290,000	
	い第８３２号商工債	200,000,000	199,918,000	
	い第８３３号商工債	100,000,000	99,931,000	
	い第８４３号商工債	200,000,000	200,250,000	
	い第８４７号商工債	100,000,000	100,019,000	
	い第８５０号商工債	200,000,000	199,958,000	
	第３３９回信金中金債（５年）	200,000,000	200,152,000	
	第３４２回信金中金債（５年）	100,000,000	100,094,000	
	第３５０回信金中金債（５年）	100,000,000	100,070,000	

	第３６０回信金中金債（５年）	200,000,000	199,742,000	
	第３７６回信金中金債（５年）	100,000,000	99,958,000	
	第２５４号商工債（３年）	300,000,000	299,901,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	101,690,000	
	第２１回国際協力機構債券	100,000,000	115,905,000	
	第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,689,000	
	第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,474,000	
	第７３回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,785,000	
	第８６回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,902,000	
	第８３回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,018,000	
	第６０回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,883,000	
	第６３回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,908,000	
	第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,116,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,161,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	198,264,000	
特殊債券合計		37,795,213,000	39,212,798,662	
社債券	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	100,096,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	299,193,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,057,000	
	第２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	400,000,000	401,624,000	
	第８回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,131,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,868,000	
	第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,092,000	
	第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,001,000	
	第１回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債	400,000,000	400,696,000	
	第１２回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	400,000,000	400,300,000	
	第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,948,000	
	第３９回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,894,000	
	第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,195,000	
	第１５回株式会社長谷工コーポレーション無	200,000,000	199,510,000	

	担保社債			
	第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	299,220,000	
	第２５回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,511,000	
	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	100,256,000	
	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	199,624,000	
	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	100,327,000	
	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	199,754,000	
	第１０回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,453,000	
	第１９回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,264,000	
	第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,199,000	
	第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,375,000	
	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	99,867,000	
	第１８回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,924,000	
	第２５回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,090,000	
	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	200,274,000	
	第１３回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,864,000	
	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	100,758,000	
	第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	100,279,000	
	第２４回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,501,000	
	第３２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,646,000	
	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	200,210,000	
	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	99,610,000	
	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	98,601,000	
	第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,447,000	
	第７回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,658,000	
	第４回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,107,000	
	第６回株式会社電通無担保社債	200,000,000	201,506,000	
	第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,767,000	
	第２回大塚ホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,225,000	

	社債			
	第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	100,000,000	100,022,000	
	第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	98,797,000	
	第１５回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,878,000	
	第１９回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,744,000	
	第１４回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,896,000	
	第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,062,000	
	第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,551,000	
	第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,180,000	
	第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,126,000	
	第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,481,000	
	第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,044,000	
	第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,423,000	
	第８回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,796,000	
	第１７回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	107,382,000	
	第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,959,000	
	第１回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,850,000	
	第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,107,000	
	第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,015,000	
	第１６回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,270,000	
	第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	202,260,000	
	第２０回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,880,000	
	第２１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,001,000	
	第２３回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,840,000	
	第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,205,000	
	第１９回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,427,000	
	第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,296,000	
	第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,113,000	
	第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,094,000	
	第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,880,000	
	第２７回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	199,890,000	
	第１２回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,874,000	
	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	100,105,000	

	第８回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	99,827,000	
	第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,103,000	
	第２１回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,326,000	
	第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	96,391,000	
	第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,544,000	
	第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,563,000	
	第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	116,697,000	
	第７３回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	199,998,000	
	第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,431,000	
	第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,902,000	
	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	100,548,000	
	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	117,910,000	
	第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	111,109,000	
	第１回三井住友ＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	101,167,000	
	第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,258,000	
	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	304,038,000	
	第３回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,159,000	
	第４回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,131,000	
	第９回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,053,000	
	第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,548,000	
	第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	201,380,000	
	第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	99,195,000	
	第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,000,000	
	第６４回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,646,000	
	第６５回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,075,000	
	第６７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,981,000	
	第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,056,000	
	第４１回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,664,000	
	第７回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	200,000,000	199,950,000	

	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	99,800,000	
	第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,060,000	
	第３２回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,784,000	
	第３５回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,735,000	
	第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	103,476,000	
	第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,205,000	
	第８０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,266,000	
	第８７回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,810,000	
	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	200,304,000	
	第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,101,000	
	第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	201,236,000	
	第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,965,000	
	第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,938,000	
	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	100,078,000	
	第１回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,040,000	
	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	99,659,000	
	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	199,952,000	
	第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,782,000	
	第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	200,316,000	
	第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	97,933,000	
	第１３５回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,280,000	
	第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,648,000	
	第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,669,000	
	第１０９回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,292,000	
	第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,377,000	
	第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,667,000	
	第１２４回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,720,000	
	第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,104,000	
	第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,788,000	
	第４６回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,624,000	
	第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,944,000	

	第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,762,000	
	第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	95,597,000	
	第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,357,000	
	第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,902,000	
	第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,666,000	
	第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	229,128,000	
	第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,576,000	
	第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,277,000	
	第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,036,000	
	第１４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,080,000	
	第１５９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,099,000	
	第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,216,000	
	第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,063,000	
	第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,430,000	
	第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,404,000	
	第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,025,000	
	第５９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,995,000	
	第７５回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	98,883,000	
	第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	128,289,000	
	第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	122,699,000	
	第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,680,000	
	第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,576,000	
	第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	92,635,000	
	第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	91,255,000	
	第５４回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	100,553,000	
	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	192,066,000	
	第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,716,000	
	第１６回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	99,934,000	
	第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	101,339,000	
	第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,725,000	

	第１１回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	399,140,000	
	第３１回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	201,992,000	
	第３３回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,139,000	
	第３６回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	99,600,000	
	第５０３回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,403,000	
	第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,752,000	
	第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,092,000	
	第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,516,000	
	第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	97,276,000	
	第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,007,000	
	第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	202,444,000	
	第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,729,000	
	第５２４回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,020,000	
	第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,214,000	
	第５３８回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,912,000	
	第３８５回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,964,000	
	第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,897,000	
	第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,368,000	
	第４０２回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,302,000	
	第４１６回中国電力株式会社社債	200,000,000	200,284,000	
	第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,040,000	
	第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,779,000	
	第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,642,000	
	第３３０回北陸電力株式会社社債	200,000,000	199,998,000	
	第４７１回東北電力株式会社社債	126,000,000	128,491,020	
	第４８１回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,155,000	
	第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,480,000	
	第５０８回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,921,000	
	第５２１回東北電力株式会社社債	200,000,000	201,538,000	
	第５２７回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,515,000	
	第５３５回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,205,000	
	第３０９回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,282,000	
	第３１４回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,341,000	
	第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	201,494,000	
	第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,224,000	
	第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,584,000	

	第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,922,000	
	第４８９回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,403,000	
	第４９４回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,208,000	
	第３２６回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,256,000	
	第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,979,000	
	第３５０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,222,000	
	第１３回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	106,351,000	
	第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,178,000	
	第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,700,000	
	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,085,000	
	第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	207,098,000	
	第３８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	303,324,000	
	第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,102,000	
	第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	304,461,000	
	第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,242,000	
	第４４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,441,000	
	第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,452,000	
	第４８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	300,342,000	
	第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	98,149,000	
	第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	199,406,000	
	第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	199,114,000	
	第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	98,733,000	
	第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,152,000	
	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	201,736,000	
社債券合計		29,726,000,000	29,983,332,020	
合計			647,275,950,170	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月 20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,855,341,167
株式	478,384,690,050
派生商品評価勘定	1,307,050
未収入金	111,931,080
未収配当金	671,549,733
前払金	87,500,600
差入委託証拠金	147,495,000
流動資産合計	482,259,814,680
資産合計	482,259,814,680
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	88,826,350
未払解約金	188,443,078
未払利息	4,281
流動負債合計	277,273,709
負債合計	277,273,709
純資産の部	
元本等	
元本	254,903,427,075
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	227,079,113,896
元本等合計	481,982,540,971
純資産合計	481,982,540,971
負債純資産合計	482,259,814,680

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 1月 20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	254,903,427,075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 1.8908円 (1万口当たり純資産額) (18,908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 1月 20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

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

	短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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 1月 20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月 21日
期首元本額	211,981,845,770円
期中追加設定元本額	72,330,508,234円
期中一部解約元本額	29,408,926,929円
期末元本額	254,903,427,075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）	408,159,824円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,921,141,648円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	15,768,943円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	11,200,895,614円
世界経済インデックスファンド	3,488,644,943円
日本株式インデックス・オープン	3,378,223,126円
ＤＣマイセレクション２５	6,097,099,944円
ＤＣマイセレクション５０	18,225,218,160円
ＤＣマイセレクション７５	18,400,640,933円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	6,034,347,876円
ＤＣマイセレクションＳ２５	3,007,744,182円
ＤＣマイセレクションＳ５０	8,765,668,257円
ＤＣマイセレクションＳ７５	6,484,089,086円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	7,985,893,097円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	223,390,964円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	699,382,339円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	503,044,042円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,448,735,396円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,605,027,279円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,883,786円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	20,056,444円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	20,644,035円
日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	190,379,761円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,239,914円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	33,959,121円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	127,312,851円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	25,932,294円

バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	85,912,603円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	974,441,481円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	446,141,439円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,912,344,874円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	77,482,956円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	26,535,537円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	510,661,983円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	282,197,555円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	366,966,879円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	37,133,693円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	594,125,943円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	3,528,653,872円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,898,156,116円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,344,624,777円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,711,030,971円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,375,097,034円
分散投資コア戦略ファンドＳ	5,791,455,986円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	448,410,441円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	407,088,624円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,011,436,769円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	216,766,384円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,787,763円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	58,068,852円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	26,688,154,154円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	559,164,334円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	41,637,953円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	150,556,024円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	28,364,728円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	7,265,088円
グローバル経済コア	215,653,204円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	25,462,864円
ｉ－ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	90,031,575円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	20,547,117円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,270,588,596円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	169,958,346円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	6,568,493円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	4,525,364円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	2,362,872円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	2,528,273円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	42,869,552,502円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,042,634,767円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	252,585,387円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	45,105,237円
ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用）	47,734,272,173円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	10,401,234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）	230,460,399円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 1月 20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,781,582,047
合計	3,781,582,047

(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 1月 20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,344,180,600	－	3,256,680,000	△87,500,600
合計		3,344,180,600	－	3,256,680,000	△87,500,600

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	8,600	3,060.00	26,316,000	
日本水産	245,200	529.00	129,710,800	
マルハニチロ	38,400	2,365.00	90,816,000	
雪国まいたけ	17,900	1,188.00	21,265,200	
カネコ種苗	7,400	1,481.00	10,959,400	
サカタのタネ	29,200	3,270.00	95,484,000	
ホクト	20,600	1,907.00	39,284,200	
ホクリヨウ	3,300	689.00	2,273,700	
住石ホールディングス	42,900	136.00	5,834,400	
日鉄鉱業	5,600	6,410.00	35,896,000	
三井松島ホールディングス	10,300	1,607.00	16,552,100	
ＩＮＰＥＸ	983,600	1,118.00	1,099,664,800	
石油資源開発	28,800	2,742.00	78,969,600	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	11,800	1,447.00	17,074,600	
ヒノキヤグループ	5,300	2,022.00	10,716,600	
ショーボンドホールディングス	35,000	4,940.00	172,900,000	
ミライト・ホールディングス	78,900	1,821.00	143,676,900	

タマホーム	14,900	2,406.00	35,849,400	
サンヨーホームズ	2,800	735.00	2,058,000	
日本アクア	9,700	644.00	6,246,800	
ファーストコーポレーション	7,500	684.00	5,130,000	
ベステラ	4,900	1,291.00	6,325,900	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	40,900	226.00	9,243,400	
キャンディル	4,200	486.00	2,041,200	
ダイセキ環境ソリューション	4,700	1,223.00	5,748,100	
第一カッター興業	6,100	1,295.00	7,899,500	
安藤・間	121,800	874.00	106,453,200	
東急建設	71,800	689.00	49,470,200	
コムシスホールディングス	79,000	2,691.00	212,589,000	
ビーアールホールディングス	33,400	349.00	11,656,600	
高松コンストラクショングループ	15,300	1,940.00	29,682,000	
東建コーポレーション	7,600	9,180.00	69,768,000	
ソネック	2,500	1,022.00	2,555,000	
ヤマウラ	11,800	949.00	11,198,200	
オリエンタル白石	82,400	238.00	19,611,200	
大成建設	163,600	3,705.00	606,138,000	
大林組	566,200	916.00	518,639,200	
清水建設	530,400	760.00	403,104,000	
飛島建設	15,200	1,025.00	15,580,000	
長谷工コーポレーション	168,600	1,421.00	239,580,600	
松井建設	22,300	697.00	15,543,100	
錢高組	2,500	4,010.00	10,025,000	
鹿島建設	414,900	1,361.00	564,678,900	
不動テトラ	12,000	1,607.00	19,284,000	
大末建設	5,900	1,290.00	7,611,000	
鉄建建設	12,300	1,787.00	21,980,100	
西松建設	34,300	3,710.00	127,253,000	
三井住友建設	127,700	430.00	54,911,000	
大豊建設	8,300	3,705.00	30,751,500	
佐田建設	12,200	461.00	5,624,200	
ナカノフドー建設	13,500	331.00	4,468,500	
奥村組	33,300	3,235.00	107,725,500	
東鉄工業	26,300	2,406.00	63,277,800	

イチケン	4,100	1,840.00	7,544,000	
富士ピー・エス	7,300	483.00	3,525,900	
淺沼組	6,300	5,380.00	33,894,000	
戸田建設	235,100	724.00	170,212,400	
熊谷組	28,900	2,950.00	85,255,000	
北野建設	3,400	2,139.00	7,272,600	
植木組	5,000	1,405.00	7,025,000	
矢作建設工業	25,000	739.00	18,475,000	
ピーエス三菱	18,600	593.00	11,029,800	
日本ハウスホールディングス	38,600	440.00	16,984,000	
大東建託	57,900	13,340.00	772,386,000	
新日本建設	24,100	755.00	18,195,500	
東亜道路工業	2,900	4,840.00	14,036,000	
日本道路	5,500	8,250.00	45,375,000	
東亜建設工業	13,900	2,369.00	32,929,100	
日本国土開発	55,100	523.00	28,817,300	
若築建設	9,400	1,698.00	15,961,200	
東洋建設	63,500	552.00	35,052,000	
五洋建設	224,400	638.00	143,167,200	
世紀東急工業	27,200	790.00	21,488,000	
福田組	6,000	4,160.00	24,960,000	
住友林業	144,900	2,044.00	296,175,600	
日本基礎技術	15,600	578.00	9,016,800	
巴コーポレーション	25,100	484.00	12,148,400	
大和ハウス工業	522,800	3,319.00	1,735,173,200	
ライト工業	35,600	1,855.00	66,038,000	
積水ハウス	614,100	2,332.00	1,432,081,200	
日特建設	11,700	641.00	7,499,700	
北陸電気工事	11,700	810.00	9,477,000	
ユアテック	32,400	640.00	20,736,000	
日本リーテック	11,800	1,383.00	16,319,400	
四電工	6,200	1,660.00	10,292,000	
中電工	26,100	2,095.00	54,679,500	
関電工	92,100	845.00	77,824,500	
きんでん	126,500	1,684.00	213,026,000	
東京エネシス	18,800	946.00	17,784,800	

トーエネック	5,700	3,125.00	17,812,500	
住友電設	14,000	2,013.00	28,182,000	
日本電設工業	31,000	1,459.00	45,229,000	
エクシオグループ	85,400	2,363.00	201,800,200	
新日本空調	15,000	2,039.00	30,585,000	
九電工	43,700	3,420.00	149,454,000	
三機工業	36,800	1,415.00	52,072,000	
日揮ホールディングス	174,400	1,072.00	186,956,800	
中外炉工業	5,700	1,590.00	9,063,000	
ヤマト	16,600	706.00	11,719,600	
太平電業	12,500	2,699.00	33,737,500	
高砂熱学工業	51,200	1,897.00	97,126,400	
三晃金属工業	2,200	2,362.00	5,196,400	
朝日工業社	3,800	2,824.00	10,731,200	
明星工業	36,600	694.00	25,400,400	
大氣社	27,500	2,962.00	81,455,000	
ダイダン	12,600	2,219.00	27,959,400	
日比谷総合設備	18,200	1,870.00	34,034,000	
フィル・カンパニー	3,200	1,116.00	3,571,200	
テスホールディングス	10,300	1,430.00	14,729,000	
インフロニア・ホールディングス	241,400	1,074.00	259,263,600	
東洋エンジニアリング	23,800	674.00	16,041,200	
レイズネクスト	27,300	1,143.00	31,203,900	
ニップン	53,000	1,609.00	85,277,000	
日清製粉グループ本社	204,700	1,574.00	322,197,800	
日東富士製粉	2,600	3,760.00	9,776,000	
昭和産業	17,100	2,653.00	45,366,300	
鳥越製粉	16,100	625.00	10,062,500	
中部飼料	20,400	985.00	20,094,000	
フィード・ワン	24,300	687.00	16,694,100	
東洋精糖	3,100	1,033.00	3,202,300	
日本甜菜製糖	9,400	1,655.00	15,557,000	
DM三井製糖ホールディングス	16,500	1,941.00	32,026,500	
塩水港精糖	21,600	211.00	4,557,600	
日新製糖	8,600	1,706.00	14,671,600	
森永製菓	42,500	3,650.00	155,125,000	

中村屋	4,400	3,400.00	14,960,000	
江崎グリコ	49,900	3,695.00	184,380,500	
名糖産業	8,000	1,655.00	13,240,000	
井村屋グループ	10,300	2,165.00	22,299,500	
不二家	10,100	2,192.00	22,139,200	
山崎製パン	135,800	1,484.00	201,527,200	
第一屋製パン	3,500	528.00	1,848,000	
モロゾフ	2,900	5,550.00	16,095,000	
亀田製菓	10,300	4,105.00	42,281,500	
寿スピリッツ	17,400	4,870.00	84,738,000	
カルビー	82,600	2,644.00	218,394,400	
森永乳業	33,500	5,390.00	180,565,000	
六甲バター	13,200	1,477.00	19,496,400	
ヤクルト本社	134,200	5,810.00	779,702,000	
明治ホールディングス	119,800	6,960.00	833,808,000	
雪印メグミルク	43,600	2,002.00	87,287,200	
プリマハム	22,700	2,505.00	56,863,500	
日本ハム	69,300	4,315.00	299,029,500	
林兼産業	5,500	506.00	2,783,000	
丸大食品	17,800	1,527.00	27,180,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	16,300	3,290.00	53,627,000	
柿安本店	6,300	2,537.00	15,983,100	
伊藤ハム米久ホールディングス	116,700	661.00	77,138,700	
サッポロホールディングス	61,800	2,192.00	135,465,600	
アサヒグループホールディングス	426,300	4,768.00	2,032,598,400	
キリンホールディングス	666,000	1,849.00	1,231,434,000	
宝ホールディングス	123,100	1,136.00	139,841,600	
オエノンホールディングス	51,500	324.00	16,686,000	
養命酒製造	5,500	1,733.00	9,531,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	127,200	1,332.00	169,430,400	
サントリー食品インターナショナル	121,200	4,305.00	521,766,000	
ダイドーグループホールディングス	9,300	4,600.00	42,780,000	
伊藤園	55,000	6,160.00	338,800,000	
キーコーヒー	17,800	2,000.00	35,600,000	
ユニカフェ	5,400	926.00	5,000,400	

ジャパンフーズ	2,600	1,205.00	3,133,000	
日清オイリオグループ	22,700	2,944.00	66,828,800	
不二製油グループ本社	39,300	2,283.00	89,721,900	
かどや製油	2,000	3,990.00	7,980,000	
Ｊ－オイルミルズ	16,900	1,688.00	28,527,200	
キッコーマン	130,400	8,450.00	1,101,880,000	
味の素	400,200	3,238.00	1,295,847,600	
ブルドックソース	7,600	2,016.00	15,321,600	
キユーピー	95,200	2,290.00	218,008,000	
ハウス食品グループ本社	67,800	2,870.00	194,586,000	
カゴメ	68,800	2,938.00	202,134,400	
焼津水産化学工業	8,800	907.00	7,981,600	
アリアケジャパン	16,600	6,050.00	100,430,000	
ピエトロ	2,400	1,790.00	4,296,000	
エバラ食品工業	4,000	2,796.00	11,184,000	
やまみ	2,000	1,786.00	3,572,000	
ニチレイ	82,600	2,532.00	209,143,200	
東洋水産	87,000	4,690.00	408,030,000	
イートアンドホールディングス	6,800	2,292.00	15,585,600	
大冷	2,000	1,908.00	3,816,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,300	506.00	4,705,800	
日清食品ホールディングス	71,100	7,880.00	560,268,000	
永谷園ホールディングス	8,000	1,895.00	15,160,000	
一正蒲鉾	7,000	750.00	5,250,000	
フジッコ	19,500	1,903.00	37,108,500	
ロック・フィールド	19,500	1,486.00	28,977,000	
日本たばこ産業	971,600	2,344.50	2,277,916,200	
ケンコーマヨネーズ	10,200	1,312.00	13,382,400	
わらべや日洋ホールディングス	11,900	1,870.00	22,253,000	
なとり	10,100	1,974.00	19,937,400	
イフジ産業	3,200	914.00	2,924,800	
ピックルスコーポレーション	8,600	1,509.00	12,977,400	
ファーマフーズ	17,100	1,757.00	30,044,700	
ユーグレナ	92,300	683.00	63,040,900	
紀文食品	10,600	918.00	9,730,800	
ミヨシ油脂	6,900	1,140.00	7,866,000	

理研ビタミン	18,800	1,670.00	31,396,000	
片倉工業	19,800	2,273.00	45,005,400	
グンゼ	12,000	3,955.00	47,460,000	
東洋紡	70,300	1,269.00	89,210,700	
ユニチカ	50,100	308.00	15,430,800	
富士紡ホールディングス	8,000	4,025.00	32,200,000	
倉敷紡績	15,400	1,849.00	28,474,600	
シキボウ	9,300	908.00	8,444,400	
日本毛織	53,800	901.00	48,473,800	
トーア紡コーポレーション	6,500	412.00	2,678,000	
帝国繊維	20,200	1,863.00	37,632,600	
帝人	166,800	1,451.00	242,026,800	
東レ	1,281,000	734.70	941,150,700	
住江織物	3,900	1,759.00	6,860,100	
日本フエルト	11,100	438.00	4,861,800	
イチカワ	2,600	1,352.00	3,515,200	
日東製網	1,900	1,431.00	2,718,900	
アツギ	13,900	539.00	7,492,100	
ダイニック	6,700	697.00	4,669,900	
セーレン	36,400	2,349.00	85,503,600	
ソトー	6,700	811.00	5,433,700	
東海染工	2,200	1,125.00	2,475,000	
小松マテーレ	29,200	1,218.00	35,565,600	
ワコールホールディングス	44,200	2,073.00	91,626,600	
ホギメディカル	23,900	3,025.00	72,297,500	
ＴＳＩホールディングス	59,600	335.00	19,966,000	
マツオカコーポレーション	5,800	1,153.00	6,687,400	
ワールド	23,300	1,122.00	26,142,600	
三陽商会	8,500	860.00	7,310,000	
ナイガイ	6,600	287.00	1,894,200	
オンワードホールディングス	106,800	304.00	32,467,200	
ルックホールディングス	5,800	1,137.00	6,594,600	
ゴールドウイン	31,900	6,130.00	195,547,000	
デサント	34,500	3,740.00	129,030,000	
キング	8,800	518.00	4,558,400	
ヤマトインターナショナル	16,200	286.00	4,633,200	

特種東海製紙	10,900	4,010.00	43,709,000	
王子ホールディングス	739,200	592.00	437,606,400	
日本製紙	84,700	1,144.00	96,896,800	
三菱製紙	25,100	311.00	7,806,100	
北越コーポレーション	115,900	736.00	85,302,400	
中越パルプ工業	6,700	955.00	6,398,500	
巴川製紙所	5,300	743.00	3,937,900	
大王製紙	85,300	1,932.00	164,799,600	
阿波製紙	4,600	326.00	1,499,600	
レンゴー	167,100	869.00	145,209,900	
トーモク	10,800	1,712.00	18,489,600	
ザ・パック	13,400	2,591.00	34,719,400	
北の達人コーポレーション	63,300	259.00	16,394,700	
クラレ	258,600	1,024.00	264,806,400	
旭化成	1,172,000	1,140.50	1,336,666,000	
共和レザー	11,000	640.00	7,040,000	
昭和電工	153,300	2,458.00	376,811,400	
住友化学	1,299,100	585.00	759,973,500	
住友精化	7,800	3,115.00	24,297,000	
日産化学	96,200	6,200.00	596,440,000	
ラサ工業	6,200	1,570.00	9,734,000	
クレハ	14,000	8,620.00	120,680,000	
多木化学	6,900	5,240.00	36,156,000	
テイカ	13,000	1,240.00	16,120,000	
石原産業	29,400	1,151.00	33,839,400	
片倉コープアグリ	4,200	1,135.00	4,767,000	
日本曹達	22,600	3,195.00	72,207,000	
東ソー	255,100	1,782.00	454,588,200	
トクヤマ	56,600	1,858.00	105,162,800	
セントラル硝子	28,900	2,092.00	60,458,800	
東亞合成	100,700	1,114.00	112,179,800	
大阪ソーダ	16,500	2,971.00	49,021,500	
関東電化工業	38,700	1,082.00	41,873,400	
デンカ	64,500	3,915.00	252,517,500	
信越化学工業	303,600	19,100.00	5,798,760,000	
日本カーバイド工業	6,300	1,292.00	8,139,600	

堺化学工業	12,400	2,149.00	26,647,600	
第一稀元素化学工業	16,400	1,125.00	18,450,000	
エア・ウォーター	167,400	1,769.00	296,130,600	
日本酸素ホールディングス	169,900	2,383.00	404,871,700	
日本化学工業	5,500	2,665.00	14,657,500	
東邦アセチレン	2,900	1,230.00	3,567,000	
日本パーカライジング	89,200	1,040.00	92,768,000	
高圧ガス工業	28,000	724.00	20,272,000	
チタン工業	2,000	1,711.00	3,422,000	
四国化成工業	23,100	1,386.00	32,016,600	
戸田工業	3,800	3,590.00	13,642,000	
ステラ　ケミファ	8,900	2,504.00	22,285,600	
保土谷化学工業	5,700	5,610.00	31,977,000	
日本触媒	29,700	5,320.00	158,004,000	
大日精化工業	14,600	2,208.00	32,236,800	
カネカ	45,700	3,710.00	169,547,000	
三菱瓦斯化学	164,500	2,152.00	354,004,000	
三井化学	160,600	3,190.00	512,314,000	
ＪＳＲ	164,800	3,995.00	658,376,000	
東京応化工業	30,300	6,610.00	200,283,000	
大阪有機化学工業	15,100	3,335.00	50,358,500	
三菱ケミカルホールディングス	1,182,000	905.50	1,070,301,000	
ＫＨネオケム	29,200	2,985.00	87,162,000	
ダイセル	254,700	855.00	217,768,500	
住友ベークライト	27,800	5,900.00	164,020,000	
積水化学工業	370,000	1,892.00	700,040,000	
日本ゼオン	159,500	1,348.00	215,006,000	
アイカ工業	49,300	3,220.00	158,746,000	
宇部興産	83,300	2,065.00	172,014,500	
積水樹脂	26,700	2,022.00	53,987,400	
タキロンシーアイ	38,300	542.00	20,758,600	
旭有機材	10,000	1,670.00	16,700,000	
ニチバン	10,500	1,719.00	18,049,500	
リケンテクノス	43,100	481.00	20,731,100	
大倉工業	9,000	1,977.00	17,793,000	
積水化成品工業	23,700	466.00	11,044,200	

群栄化学工業	4,000	3,465.00	13,860,000	
タイガースポリマー	9,300	441.00	4,101,300	
ミライアル	5,700	1,613.00	9,194,100	
ダイキアクシス	6,900	693.00	4,781,700	
ダイキョーニシカワ	37,300	596.00	22,230,800	
竹本容器	6,300	761.00	4,794,300	
森六ホールディングス	9,500	1,909.00	18,135,500	
恵和	4,800	5,710.00	27,408,000	
日本化薬	139,300	1,116.00	155,458,800	
カーリットホールディングス	17,500	668.00	11,690,000	
日本精化	14,200	2,322.00	32,972,400	
扶桑化学工業	15,900	4,545.00	72,265,500	
トリケミカル研究所	18,200	3,190.00	58,058,000	
ＡＤＥＫＡ	81,400	2,425.00	197,395,000	
日油	60,400	5,220.00	315,288,000	
新日本理化	29,300	250.00	7,325,000	
ハリマ化成グループ	13,200	804.00	10,612,800	
花王	399,400	5,748.00	2,295,751,200	
第一工業製薬	6,600	3,020.00	19,932,000	
石原ケミカル	8,900	1,304.00	11,605,600	
日華化学	6,000	814.00	4,884,000	
ニイタカ	3,700	2,169.00	8,025,300	
三洋化成工業	10,600	5,120.00	54,272,000	
有機合成薬品工業	12,300	270.00	3,321,000	
大日本塗料	21,600	800.00	17,280,000	
日本ペイントホールディングス	664,400	942.00	625,864,800	
関西ペイント	183,400	2,391.00	438,509,400	
神東塗料	13,900	153.00	2,126,700	
中国塗料	41,700	914.00	38,113,800	
日本特殊塗料	13,200	872.00	11,510,400	
藤倉化成	22,000	476.00	10,472,000	
太陽ホールディングス	26,000	3,315.00	86,190,000	
ＤＩＣ	74,700	2,948.00	220,215,600	
サカタインクス	35,100	958.00	33,625,800	
東洋インキＳＣホールディングス	37,400	1,885.00	70,499,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	14,300	777.00	11,111,100	

富士フイルムホールディングス	317,300	7,897.00	2,505,718,100	
資生堂	336,300	5,885.00	1,979,125,500	
ライオン	218,000	1,511.00	329,398,000	
高砂香料工業	12,400	2,749.00	34,087,600	
マンダム	37,900	1,366.00	51,771,400	
ミルボン	22,300	5,380.00	119,974,000	
ファンケル	73,100	2,934.00	214,475,400	
コーセー	34,000	10,980.00	373,320,000	
コタ	11,400	1,560.00	17,784,000	
シーボン	2,300	1,705.00	3,921,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	77,100	1,745.00	134,539,500	
ノエビアホールディングス	15,300	5,010.00	76,653,000	
アジュバンホールディングス	4,000	1,125.00	4,500,000	
新日本製薬	4,900	1,086.00	5,321,400	
エステー	11,600	1,481.00	17,179,600	
アグロ　カネショウ	6,000	1,176.00	7,056,000	
コニシ	29,700	1,623.00	48,203,100	
長谷川香料	31,100	2,460.00	76,506,000	
星光ＰＭＣ	10,200	659.00	6,721,800	
小林製薬	50,600	8,530.00	431,618,000	
荒川化学工業	15,000	1,131.00	16,965,000	
メック	13,500	3,345.00	45,157,500	
日本高純度化学	5,000	2,492.00	12,460,000	
タカラバイオ	47,200	2,380.00	112,336,000	
ＪＣＵ	20,300	4,995.00	101,398,500	
新田ゼラチン	11,300	635.00	7,175,500	
ＯＡＴアグリオ	3,700	1,903.00	7,041,100	
デクセリアルズ	46,900	3,245.00	152,190,500	
アース製薬	14,800	5,840.00	86,432,000	
北興化学工業	16,800	852.00	14,313,600	
大成ラミック	5,500	2,701.00	14,855,500	
クミアイ化学工業	67,200	776.00	52,147,200	
日本農薬	32,200	504.00	16,228,800	
アキレス	11,600	1,224.00	14,198,400	
有沢製作所	26,400	1,029.00	27,165,600	
日東電工	109,100	8,910.00	972,081,000	

レック	23,500	842.00	19,787,000	
三光合成	18,900	344.00	6,501,600	
きもと	27,600	212.00	5,851,200	
藤森工業	16,200	4,020.00	65,124,000	
前澤化成工業	11,500	1,246.00	14,329,000	
未来工業	6,500	1,534.00	9,971,000	
ウェーブロックホールディングス	6,900	723.00	4,988,700	
ＪＳＰ	10,600	1,594.00	16,896,400	
エフピコ	33,200	3,735.00	124,002,000	
天馬	14,700	2,474.00	36,367,800	
信越ポリマー	32,400	1,044.00	33,825,600	
東リ	45,000	211.00	9,495,000	
ニフコ	60,300	3,740.00	225,522,000	
バルカー	14,700	2,553.00	37,529,100	
ユニ・チャーム	348,000	4,728.00	1,645,344,000	
ショーエイコーポレーション	4,800	646.00	3,100,800	
協和キリン	211,900	2,925.00	619,807,500	
武田薬品工業	1,419,000	3,325.00	4,718,175,000	
アステラス製薬	1,565,400	1,903.00	2,978,956,200	
大日本住友製薬	111,500	1,346.00	150,079,000	
塩野義製薬	227,000	7,000.00	1,589,000,000	
わかもと製薬	21,500	296.00	6,364,000	
日本新薬	47,300	7,420.00	350,966,000	
中外製薬	564,700	3,689.00	2,083,178,300	
科研製薬	28,300	4,210.00	119,143,000	
エーザイ	216,100	5,996.00	1,295,735,600	
ロート製薬	92,700	3,110.00	288,297,000	
小野薬品工業	414,600	2,716.50	1,126,260,900	
久光製薬	47,700	3,445.00	164,326,500	
持田製薬	22,800	3,445.00	78,546,000	
参天製薬	336,700	1,305.00	439,393,500	
扶桑薬品工業	6,400	2,270.00	14,528,000	
日本ケミファ	2,100	2,007.00	4,214,700	
ツムラ	55,900	3,295.00	184,190,500	
日医工	56,000	723.00	40,488,000	
キッセイ薬品工業	31,900	2,289.00	73,019,100	

生化学工業	31,800	943.00	29,987,400	
栄研化学	31,700	1,803.00	57,155,100	
日水製薬	6,600	974.00	6,428,400	
鳥居薬品	9,700	2,731.00	26,490,700	
ＪＣＲファーマ	50,900	2,030.00	103,327,000	
東和薬品	26,000	2,695.00	70,070,000	
富士製薬工業	11,100	977.00	10,844,700	
ゼリア新薬工業	32,800	1,966.00	64,484,800	
第一三共	1,418,800	2,608.50	3,700,939,800	
キョーリン製薬ホールディングス	36,200	1,799.00	65,123,800	
大幸薬品	27,200	692.00	18,822,400	
ダイト	11,600	2,715.00	31,494,000	
大塚ホールディングス	375,200	4,130.00	1,549,576,000	
大正製薬ホールディングス	43,000	5,360.00	230,480,000	
ペプチドリーム	94,700	2,271.00	215,063,700	
あすか製薬ホールディングス	20,600	971.00	20,002,600	
サワイグループホールディングス	39,500	4,315.00	170,442,500	
日本コークス工業	152,500	134.00	20,435,000	
ニチレキ	23,100	1,287.00	29,729,700	
ユシロ化学工業	9,300	1,074.00	9,988,200	
ビーピー・カストロール	6,400	1,290.00	8,256,000	
富士石油	48,200	258.00	12,435,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	6,000	1,129.00	6,774,000	
出光興産	200,400	3,195.00	640,278,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,716,000	458.30	1,244,742,800	
コスモエネルギーホールディングス	52,300	2,346.00	122,695,800	
横浜ゴム	104,500	1,752.00	183,084,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	95,000	1,702.00	161,690,000	
ブリヂストン	520,100	5,030.00	2,616,103,000	
住友ゴム工業	162,200	1,188.00	192,693,600	
藤倉コンポジット	14,500	863.00	12,513,500	
オカモト	10,700	4,085.00	43,709,500	
フコク	7,900	988.00	7,805,200	
ニッタ	18,700	2,766.00	51,724,200	
住友理工	35,000	596.00	20,860,000	
三ツ星ベルト	21,900	2,079.00	45,530,100	

バンドー化学	29,100	868.00	25,258,800	
日東紡績	26,900	2,834.00	76,234,600	
ＡＧＣ	165,700	5,110.00	846,727,000	
日本板硝子	86,700	528.00	45,777,600	
石塚硝子	3,100	2,078.00	6,441,800	
日本山村硝子	7,000	779.00	5,453,000	
日本電気硝子	72,600	2,842.00	206,329,200	
オハラ	7,200	1,103.00	7,941,600	
住友大阪セメント	33,400	3,530.00	117,902,000	
太平洋セメント	102,600	2,288.00	234,748,800	
日本ヒューム	18,200	692.00	12,594,400	
日本コンクリート工業	36,000	281.00	10,116,000	
三谷セキサン	8,400	6,340.00	53,256,000	
アジアパイルホールディングス	28,000	439.00	12,292,000	
東海カーボン	151,400	1,242.00	188,038,800	
日本カーボン	9,300	4,000.00	37,200,000	
東洋炭素	11,800	2,895.00	34,161,000	
ノリタケカンパニーリミテド	10,000	4,580.00	45,800,000	
ＴＯＴＯ	129,000	4,985.00	643,065,000	
日本碍子	195,600	1,942.00	379,855,200	
日本特殊陶業	137,400	2,011.00	276,311,400	
ＭＡＲＵＷＡ	6,200	15,810.00	98,022,000	
品川リフラクトリーズ	4,300	3,845.00	16,533,500	
黒崎播磨	3,100	4,620.00	14,322,000	
ヨータイ	11,500	1,230.00	14,145,000	
イソライト工業	8,000	1,198.00	9,584,000	
東京窯業	23,300	297.00	6,920,100	
ニッカトー	8,300	652.00	5,411,600	
フジミインコーポレーテッド	14,500	7,110.00	103,095,000	
クニミネ工業	5,800	1,005.00	5,829,000	
エーアンドエーマテリアル	3,100	902.00	2,796,200	
ニチアス	41,800	2,641.00	110,393,800	
ニチハ	25,100	2,815.00	70,656,500	
日本製鉄	799,100	1,931.50	1,543,461,650	
神戸製鋼所	333,400	565.00	188,371,000	
中山製鋼所	28,400	425.00	12,070,000	

合同製鐵	9,700	1,404.00	13,618,800	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	482,200	1,520.00	732,944,000	
東京製鐵	60,900	1,295.00	78,865,500	
共英製鋼	20,200	1,506.00	30,421,200	
大和工業	34,200	3,570.00	122,094,000	
東京鐵鋼	7,900	1,337.00	10,562,300	
大阪製鐵	9,500	1,174.00	11,153,000	
淀川製鋼所	23,500	2,458.00	57,763,000	
丸一鋼管	63,300	2,525.00	159,832,500	
モリ工業	5,300	2,614.00	13,854,200	
大同特殊鋼	29,200	4,215.00	123,078,000	
日本高周波鋼業	6,800	352.00	2,393,600	
日本冶金工業	13,100	2,281.00	29,881,100	
山陽特殊製鋼	18,400	1,979.00	36,413,600	
愛知製鋼	10,100	2,509.00	25,340,900	
日立金属	192,400	2,085.00	401,154,000	
日本金属	4,500	1,005.00	4,522,500	
大平洋金属	11,000	2,253.00	24,783,000	
新日本電工	115,500	292.00	33,726,000	
栗本鐵工所	8,100	1,540.00	12,474,000	
虹技	2,500	985.00	2,462,500	
三菱製鋼	11,500	1,055.00	12,132,500	
日亜鋼業	23,400	279.00	6,528,600	
日本精線	2,900	4,650.00	13,485,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,600	1,645.00	12,502,000	
シンニッタン	21,900	223.00	4,883,700	
新家工業	4,400	1,637.00	7,202,800	
大紀アルミニウム工業所	27,000	1,667.00	45,009,000	
日本軽金属ホールディングス	45,200	1,791.00	80,953,200	
三井金属鉱業	48,200	3,215.00	154,963,000	
東邦亜鉛	9,900	2,401.00	23,769,900	
三菱マテリアル	118,000	2,049.00	241,782,000	
住友金属鉱山	228,200	5,052.00	1,152,866,400	
ＤＯＷＡホールディングス	48,700	5,020.00	244,474,000	
古河機械金属	29,500	1,253.00	36,963,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,700	840.00	17,388,000	

東邦チタニウム	32,100	968.00	31,072,800	
ＵＡＣＪ	27,100	2,762.00	74,850,200	
ＣＫサンエツ	3,800	4,075.00	15,485,000	
古河電気工業	55,500	2,344.00	130,092,000	
住友電気工業	667,600	1,579.00	1,054,140,400	
フジクラ	199,200	610.00	121,512,000	
昭和電線ホールディングス	15,600	1,809.00	28,220,400	
東京特殊電線	2,700	2,885.00	7,789,500	
タツタ電線	31,700	476.00	15,089,200	
カナレ電気	2,700	1,597.00	4,311,900	
平河ヒューテック	10,000	1,114.00	11,140,000	
リョービ	22,000	1,125.00	24,750,000	
アーレスティ	19,200	392.00	7,526,400	
アサヒホールディングス	71,500	2,093.00	149,649,500	
稲葉製作所	10,000	1,313.00	13,130,000	
宮地エンジニアリンググループ	5,400	3,145.00	16,983,000	
トーカロ	46,100	1,363.00	62,834,300	
アルファＣｏ	6,900	1,079.00	7,445,100	
ＳＵＭＣＯ	274,800	2,281.00	626,818,800	
川田テクノロジーズ	3,600	3,925.00	14,130,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	5,800	6,090.00	35,322,000	
ジェイテックコーポレーション	2,000	1,721.00	3,442,000	
信和	11,100	818.00	9,079,800	
東洋製罐グループホールディングス	113,700	1,326.00	150,766,200	
ホッカンホールディングス	9,800	1,405.00	13,769,000	
コロナ	9,900	878.00	8,692,200	
横河ブリッジホールディングス	30,600	2,178.00	66,646,800	
駒井ハルテック	3,300	2,277.00	7,514,100	
高田機工	1,600	2,836.00	4,537,600	
三和ホールディングス	168,300	1,230.00	207,009,000	
文化シヤッター	56,700	1,043.00	59,138,100	
三協立山	23,000	647.00	14,881,000	
アルインコ	13,000	942.00	12,246,000	
東洋シヤッター	3,900	562.00	2,191,800	
ＬＩＸＩＬ	281,000	2,684.00	754,204,000	
日本フイルコン	12,400	509.00	6,311,600	

ノーリツ	34,200	1,653.00	56,532,600	
長府製作所	18,200	1,980.00	36,036,000	
リンナイ	33,600	10,600.00	356,160,000	
ダイニチ工業	8,500	701.00	5,958,500	
日東精工	22,400	576.00	12,902,400	
三洋工業	2,200	1,819.00	4,001,800	
岡部	36,200	726.00	26,281,200	
ジーテクト	22,200	1,397.00	31,013,400	
東プレ	33,300	1,256.00	41,824,800	
高周波熱錬	31,900	597.00	19,044,300	
東京製綱	10,900	870.00	9,483,000	
サンコール	15,300	594.00	9,088,200	
モリテック　スチール	13,900	330.00	4,587,000	
パイオラックス	26,300	1,739.00	45,735,700	
エイチワン	17,500	665.00	11,637,500	
日本発條	164,200	941.00	154,512,200	
中央発條	8,600	782.00	6,725,200	
アドバネクス	2,400	1,341.00	3,218,400	
立川ブラインド工業	7,900	1,045.00	8,255,500	
三益半導体工業	13,900	2,494.00	34,666,600	
日本ドライケミカル	4,500	1,817.00	8,176,500	
日本製鋼所	54,300	4,020.00	218,286,000	
三浦工業	77,300	3,490.00	269,777,000	
タクマ	60,700	1,424.00	86,436,800	
ツガミ	42,400	1,506.00	63,854,400	
オークマ	20,900	5,070.00	105,963,000	
芝浦機械	20,200	3,745.00	75,649,000	
アマダ	282,100	1,147.00	323,568,700	
アイダエンジニアリング	47,000	1,075.00	50,525,000	
滝澤鉄工所	5,200	1,165.00	6,058,000	
ＦＵＪＩ	82,300	2,518.00	207,231,400	
牧野フライス製作所	19,600	3,955.00	77,518,000	
オーエスジー	82,700	2,015.00	166,640,500	
ダイジェット工業	2,300	962.00	2,212,600	
旭ダイヤモンド工業	47,300	588.00	27,812,400	
ＤＭＧ森精機	106,000	1,896.00	200,976,000	

ソディック	39,700	810.00	32,157,000	
ディスコ	26,300	33,250.00	874,475,000	
日東工器	9,800	1,679.00	16,454,200	
日進工具	14,100	1,410.00	19,881,000	
パンチ工業	15,100	491.00	7,414,100	
冨士ダイス	9,100	616.00	5,605,600	
豊和工業	9,500	749.00	7,115,500	
ＯＫＫ	6,800	1,039.00	7,065,200	
東洋機械金属	11,800	497.00	5,864,600	
津田駒工業	3,400	590.00	2,006,000	
エンシュウ	4,400	600.00	2,640,000	
島精機製作所	26,200	1,889.00	49,491,800	
オプトラン	22,400	2,327.00	52,124,800	
ＮＣホールディングス	5,100	1,695.00	8,644,500	
イワキポンプ	11,400	980.00	11,172,000	
フリュー	15,900	1,207.00	19,191,300	
ヤマシンフィルタ	36,200	443.00	16,036,600	
日阪製作所	22,100	806.00	17,812,600	
やまびこ	34,700	1,077.00	37,371,900	
野村マイクロ・サイエンス	4,700	4,660.00	21,902,000	
平田機工	8,500	6,180.00	52,530,000	
ペガサスミシン製造	18,300	482.00	8,820,600	
マルマエ	7,300	2,683.00	19,585,900	
タツモ	8,400	1,397.00	11,734,800	
ナブテスコ	101,900	3,625.00	369,387,500	
三井海洋開発	19,000	1,462.00	27,778,000	
レオン自動機	19,200	1,041.00	19,987,200	
ＳＭＣ	52,900	67,600.00	3,576,040,000	
ホソカワミクロン	12,600	2,993.00	37,711,800	
ユニオンツール	6,700	3,800.00	25,460,000	
オイレス工業	25,100	1,588.00	39,858,800	
日精エー・エス・ビー機械	6,100	3,210.00	19,581,000	
サトーホールディングス	23,500	2,065.00	48,527,500	
技研製作所	15,800	3,925.00	62,015,000	
日本エアーテック	8,300	1,075.00	8,922,500	
カワタ	5,800	1,051.00	6,095,800	

日精樹脂工業	12,700	1,050.00	13,335,000	
オカダアイヨン	5,700	1,451.00	8,270,700	
ワイエイシイホールディングス	7,100	1,093.00	7,760,300	
小松製作所	818,300	2,915.00	2,385,344,500	
住友重機械工業	103,400	2,935.00	303,479,000	
日立建機	72,400	2,981.00	215,824,400	
日工	25,100	612.00	15,361,200	
巴工業	7,100	2,157.00	15,314,700	
井関農機	16,900	1,349.00	22,798,100	
ＴＯＷＡ	15,500	2,660.00	41,230,000	
丸山製作所	3,800	1,458.00	5,540,400	
北川鉄工所	8,300	1,352.00	11,221,600	
ローツェ	8,900	11,540.00	102,706,000	
タカキタ	6,400	610.00	3,904,000	
クボタ	880,800	2,525.00	2,224,020,000	
荏原実業	8,400	2,213.00	18,589,200	
三菱化工機	5,900	2,080.00	12,272,000	
月島機械	33,500	1,051.00	35,208,500	
帝国電機製作所	12,700	1,375.00	17,462,500	
新東工業	40,200	689.00	27,697,800	
澁谷工業	15,900	2,571.00	40,878,900	
アイチ　コーポレーション	26,500	812.00	21,518,000	
小森コーポレーション	46,100	684.00	31,532,400	
鶴見製作所	14,000	1,652.00	23,128,000	
住友精密工業	2,700	1,970.00	5,319,000	
日本ギア工業	6,800	265.00	1,802,000	
酒井重工業	3,300	2,685.00	8,860,500	
荏原製作所	75,000	5,960.00	447,000,000	
石井鐵工所	2,600	2,979.00	7,745,400	
酉島製作所	16,600	891.00	14,790,600	
北越工業	17,000	945.00	16,065,000	
ダイキン工業	230,000	24,810.00	5,706,300,000	
オルガノ	5,200	8,700.00	45,240,000	
トーヨーカネツ	6,900	2,488.00	17,167,200	
栗田工業	97,800	5,020.00	490,956,000	
椿本チエイン	23,700	3,180.00	75,366,000	

大同工業	8,200	961.00	7,880,200	
木村化工機	15,300	744.00	11,383,200	
アネスト岩田	28,200	727.00	20,501,400	
ダイフク	99,400	8,360.00	830,984,000	
サムコ	4,500	2,334.00	10,503,000	
加藤製作所	8,900	818.00	7,280,200	
油研工業	3,200	1,723.00	5,513,600	
タダノ	94,600	1,160.00	109,736,000	
フジテック	67,000	2,700.00	180,900,000	
ＣＫＤ	53,300	2,146.00	114,381,800	
キトー	15,400	1,750.00	26,950,000	
平和	50,400	1,862.00	93,844,800	
理想科学工業	15,200	2,065.00	31,388,000	
ＳＡＮＫＹＯ	39,000	3,000.00	117,000,000	
日本金銭機械	18,400	630.00	11,592,000	
マースグループホールディングス	11,500	1,604.00	18,446,000	
フクシマガリレイ	12,400	4,285.00	53,134,000	
オーイズミ	6,600	380.00	2,508,000	
ダイコク電機	8,400	1,191.00	10,004,400	
竹内製作所	27,500	2,909.00	79,997,500	
アマノ	47,300	2,426.00	114,749,800	
ＪＵＫＩ	25,100	782.00	19,628,200	
ジャノメ	15,500	717.00	11,113,500	
マックス	24,000	1,790.00	42,960,000	
グローリー	46,400	2,139.00	99,249,600	
新晃工業	16,800	1,796.00	30,172,800	
大和冷機工業	26,200	1,126.00	29,501,200	
セガサミーホールディングス	179,100	1,889.00	338,319,900	
日本ピストンリング	6,700	1,286.00	8,616,200	
リケン	7,800	2,580.00	20,124,000	
ＴＰＲ	24,400	1,465.00	35,746,000	
ツバキ・ナカシマ	39,700	1,436.00	57,009,200	
ホシザキ	52,800	8,440.00	445,632,000	
大豊工業	14,800	826.00	12,224,800	
日本精工	340,000	785.00	266,900,000	
ＮＴＮ	388,000	240.00	93,120,000	

ジェイテクト	173,300	1,007.00	174,513,100	
不二越	15,400	4,295.00	66,143,000	
日本トムソン	49,600	628.00	31,148,800	
ＴＨＫ	104,500	2,803.00	292,913,500	
ユーシン精機	14,100	713.00	10,053,300	
前澤給装工業	13,600	975.00	13,260,000	
イーグル工業	22,400	1,095.00	24,528,000	
前澤工業	11,000	622.00	6,842,000	
日本ピラー工業	18,300	3,330.00	60,939,000	
キッツ	60,900	651.00	39,645,900	
マキタ	219,800	4,673.00	1,027,125,400	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	65,200	398.00	25,949,600	
日立造船	153,000	776.00	118,728,000	
三菱重工業	283,800	3,061.00	868,711,800	
ＩＨＩ	112,800	2,346.00	264,628,800	
スター精密	27,700	1,472.00	40,774,400	
日清紡ホールディングス	110,400	935.00	103,224,000	
イビデン	94,900	6,370.00	604,513,000	
コニカミノルタ	396,100	527.00	208,744,700	
ブラザー工業	220,900	2,227.00	491,944,300	
ミネベアミツミ	311,500	2,885.00	898,677,500	
日立製作所	868,400	6,377.00	5,537,786,800	
東芝	315,500	4,832.00	1,524,496,000	
三菱電機	1,805,300	1,472.00	2,657,401,600	
富士電機	108,800	5,740.00	624,512,000	
東洋電機製造	7,100	965.00	6,851,500	
安川電機	194,300	5,060.00	983,158,000	
シンフォニアテクノロジー	21,700	1,210.00	26,257,000	
明電舎	30,600	2,581.00	78,978,600	
オリジン	4,500	1,237.00	5,566,500	
山洋電気	8,100	5,350.00	43,335,000	
デンヨー	15,400	1,695.00	26,103,000	
ＰＨＣホールディングス	21,100	1,752.00	36,967,200	
東芝テック	19,400	4,350.00	84,390,000	
芝浦メカトロニクス	3,300	8,560.00	28,248,000	
マブチモーター	42,500	3,765.00	160,012,500	

日本電産	468,000	11,635.00	5,445,180,000	
トレックス・セミコンダクター	9,300	2,811.00	26,142,300	
東光高岳	10,800	1,394.00	15,055,200	
ダイヘン	19,700	4,335.00	85,399,500	
ヤーマン	30,300	878.00	26,603,400	
ＪＶＣケンウッド	152,100	181.00	27,530,100	
ミマキエンジニアリング	17,300	791.00	13,684,300	
Ｉ－ＰＥＸ	8,900	1,795.00	15,975,500	
日新電機	42,300	1,548.00	65,480,400	
大崎電気工業	33,100	465.00	15,391,500	
オムロン	150,300	9,610.00	1,444,383,000	
日東工業	24,100	1,529.00	36,848,900	
ＩＤＥＣ	22,300	2,489.00	55,504,700	
正興電機製作所	6,600	1,037.00	6,844,200	
不二電機工業	4,300	1,196.00	5,142,800	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	60,300	2,528.00	152,438,400	
サクサホールディングス	4,200	1,270.00	5,334,000	
メルコホールディングス	5,200	3,690.00	19,188,000	
テクノメディカ	4,700	1,610.00	7,567,000	
日本電気	229,400	5,180.00	1,188,292,000	
富士通	162,400	18,875.00	3,065,300,000	
沖電気工業	73,300	903.00	66,189,900	
岩崎通信機	7,400	814.00	6,023,600	
電気興業	9,500	2,360.00	22,420,000	
サンケン電気	16,900	5,140.00	86,866,000	
ナカヨ	3,300	1,172.00	3,867,600	
アイホン	10,200	2,075.00	21,165,000	
ルネサスエレクトロニクス	979,600	1,382.00	1,353,807,200	
セイコーエプソン	224,000	2,014.00	451,136,000	
ワコム	141,000	877.00	123,657,000	
アルバック	33,200	6,170.00	204,844,000	
アクセル	9,000	1,112.00	10,008,000	
ＥＩＺＯ	14,000	3,910.00	54,740,000	
日本信号	46,000	878.00	40,388,000	
京三製作所	38,700	416.00	16,099,200	
能美防災	24,300	2,080.00	50,544,000	

ホーチキ	13,900	1,201.00	16,693,900	
星和電機	10,400	623.00	6,479,200	
エレコム	41,900	1,436.00	60,168,400	
パナソニック	1,925,600	1,293.50	2,490,763,600	
シャープ	205,800	1,315.00	270,627,000	
アンリツ	116,300	1,692.00	196,779,600	
富士通ゼネラル	49,000	2,558.00	125,342,000	
ソニーグループ	1,131,000	13,135.00	14,855,685,000	
ＴＤＫ	261,700	4,235.00	1,108,299,500	
帝国通信工業	8,800	1,317.00	11,589,600	
タムラ製作所	69,600	652.00	45,379,200	
アルプスアルパイン	160,600	1,122.00	180,193,200	
池上通信機	5,300	637.00	3,376,100	
日本電波工業	16,800	1,416.00	23,788,800	
鈴木	9,300	857.00	7,970,100	
メイコー	14,800	4,200.00	62,160,000	
日本トリム	3,700	3,010.00	11,137,000	
ローランド　ディー．ジー．	10,900	2,968.00	32,351,200	
フォスター電機	18,200	738.00	13,431,600	
ＳＭＫ	4,200	2,173.00	9,126,600	
ヨコオ	13,700	2,615.00	35,825,500	
ホシデン	44,300	1,133.00	50,191,900	
ヒロセ電機	27,800	17,450.00	485,110,000	
日本航空電子工業	41,400	1,929.00	79,860,600	
ＴＯＡ	19,400	762.00	14,782,800	
マクセル	36,500	1,352.00	49,348,000	
古野電気	22,200	1,010.00	22,422,000	
ユニデンホールディングス	4,000	3,465.00	13,860,000	
スミダコーポレーション	17,700	1,041.00	18,425,700	
アイコム	6,700	2,337.00	15,657,900	
リオン	7,300	2,106.00	15,373,800	
本多通信工業	16,600	411.00	6,822,600	
横河電機	180,700	1,985.00	358,689,500	
新電元工業	7,000	3,430.00	24,010,000	
アズビル	105,800	4,720.00	499,376,000	
東亜ディーケーケー	10,200	868.00	8,853,600	

日本光電工業	74,900	3,055.00	228,819,500	
チノー	5,700	1,568.00	8,937,600	
共和電業	17,300	373.00	6,452,900	
日本電子材料	9,100	2,472.00	22,495,200	
堀場製作所	33,400	6,150.00	205,410,000	
アドバンテスト	134,200	10,050.00	1,348,710,000	
小野測器	9,800	471.00	4,615,800	
エスペック	15,000	2,027.00	30,405,000	
キーエンス	163,600	61,940.00	10,133,384,000	
日置電機	8,700	7,790.00	67,773,000	
シスメックス	152,800	11,335.00	1,731,988,000	
日本マイクロニクス	31,900	1,627.00	51,901,300	
メガチップス	17,000	4,600.00	78,200,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8,400	3,285.00	27,594,000	
澤藤電機	2,800	1,564.00	4,379,200	
原田工業	9,600	967.00	9,283,200	
コーセル	23,000	808.00	18,584,000	
イリソ電子工業	15,400	4,455.00	68,607,000	
オプテックスグループ	30,100	1,481.00	44,578,100	
千代田インテグレ	8,000	1,856.00	14,848,000	
アイ・オー・データ機器	8,100	745.00	6,034,500	
レーザーテック	79,300	28,025.00	2,222,382,500	
スタンレー電気	126,700	2,850.00	361,095,000	
岩崎電気	7,000	2,270.00	15,890,000	
ウシオ電機	93,000	1,790.00	166,470,000	
岡谷電機産業	16,400	316.00	5,182,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	19,400	293.00	5,684,200	
エノモト	5,600	1,754.00	9,822,400	
日本セラミック	17,100	2,482.00	42,442,200	
遠藤照明	9,300	992.00	9,225,600	
古河電池	13,500	1,293.00	17,455,500	
双信電機	9,600	687.00	6,595,200	
山一電機	13,400	2,088.00	27,979,200	
図研	12,000	2,979.00	35,748,000	
日本電子	37,600	6,570.00	247,032,000	
カシオ計算機	130,700	1,472.00	192,390,400	

ファナック	158,400	22,715.00	3,598,056,000	
日本シイエムケイ	37,200	594.00	22,096,800	
エンプラス	4,900	2,820.00	13,818,000	
大真空	24,900	1,305.00	32,494,500	
ローム	80,900	10,130.00	819,517,000	
浜松ホトニクス	129,600	5,990.00	776,304,000	
三井ハイテック	17,800	8,820.00	156,996,000	
新光電気工業	53,200	4,905.00	260,946,000	
京セラ	254,100	6,835.00	1,736,773,500	
太陽誘電	87,700	5,860.00	513,922,000	
村田製作所	530,400	8,653.00	4,589,551,200	
双葉電子工業	32,200	675.00	21,735,000	
北陸電気工業	7,700	1,228.00	9,455,600	
ニチコン	57,500	1,219.00	70,092,500	
日本ケミコン	17,100	1,733.00	29,634,300	
ＫＯＡ	27,800	1,503.00	41,783,400	
市光工業	23,600	518.00	12,224,800	
小糸製作所	99,300	6,260.00	621,618,000	
ミツバ	33,200	409.00	13,578,800	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	31,300	11,970.00	374,661,000	
キヤノン電子	17,100	1,544.00	26,402,400	
キヤノン	897,100	2,770.00	2,484,967,000	
リコー	501,000	1,108.00	555,108,000	
象印マホービン	49,400	1,334.00	65,899,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	3,000	2,195.00	6,585,000	
東京エレクトロン	114,600	61,310.00	7,026,126,000	
トヨタ紡織	73,600	2,200.00	161,920,000	
芦森工業	3,400	929.00	3,158,600	
ユニプレス	26,900	842.00	22,649,800	
豊田自動織機	146,100	9,390.00	1,371,879,000	
モリタホールディングス	28,900	1,273.00	36,789,700	
三櫻工業	25,000	874.00	21,850,000	
デンソー	397,500	9,191.00	3,653,422,500	
東海理化電機製作所	47,500	1,530.00	72,675,000	
川崎重工業	131,800	2,283.00	300,899,400	
名村造船所	54,200	197.00	10,677,400	

日本車輌製造	6,600	2,031.00	13,404,600	
三菱ロジスネクスト	23,900	1,037.00	24,784,300	
近畿車輌	2,700	1,004.00	2,710,800	
日産自動車	2,129,200	618.10	1,316,058,520	
いすゞ自動車	566,500	1,433.00	811,794,500	
トヨタ自動車	9,144,900	2,342.50	21,421,928,250	
日野自動車	225,400	973.00	219,314,200	
三菱自動車工業	668,300	322.00	215,192,600	
エフテック	12,600	599.00	7,547,400	
レシップホールディングス	7,200	548.00	3,945,600	
ＧＭＢ	3,300	772.00	2,547,600	
ファルテック	3,200	700.00	2,240,000	
武蔵精密工業	40,300	1,935.00	77,980,500	
日産車体	26,400	688.00	18,163,200	
新明和工業	51,000	878.00	44,778,000	
極東開発工業	33,500	1,431.00	47,938,500	
トピー工業	14,800	1,096.00	16,220,800	
ティラド	5,200	2,739.00	14,242,800	
曙ブレーキ工業	99,100	180.00	17,838,000	
タチエス	31,600	1,224.00	38,678,400	
ＮＯＫ	87,300	1,239.00	108,164,700	
フタバ産業	45,200	434.00	19,616,800	
ＫＹＢ	18,800	3,110.00	58,468,000	
大同メタル工業	34,600	617.00	21,348,200	
プレス工業	89,500	395.00	35,352,500	
ミクニ	22,900	460.00	10,534,000	
太平洋工業	37,800	1,146.00	43,318,800	
河西工業	22,100	305.00	6,740,500	
アイシン	132,100	4,410.00	582,561,000	
マツダ	566,600	943.00	534,303,800	
今仙電機製作所	12,100	584.00	7,066,400	
本田技研工業	1,421,500	3,420.00	4,861,530,000	
スズキ	412,900	4,651.00	1,920,397,900	
ＳＵＢＡＲＵ	517,400	2,123.00	1,098,440,200	
安永	8,700	859.00	7,473,300	
ヤマハ発動機	235,600	2,784.00	655,910,400	

ＴＢＫ	20,000	395.00	7,900,000	
エクセディ	27,200	1,675.00	45,560,000	
豊田合成	58,300	2,477.00	144,409,100	
愛三工業	28,300	732.00	20,715,600	
盟和産業	2,600	1,000.00	2,600,000	
日本プラスト	14,100	554.00	7,811,400	
ヨロズ	16,900	1,013.00	17,119,700	
エフ・シー・シー	29,500	1,507.00	44,456,500	
シマノ	72,500	26,860.00	1,947,350,000	
テイ・エス　テック	76,200	1,468.00	111,861,600	
ジャムコ	10,500	878.00	9,219,000	
テルモ	510,900	4,236.00	2,164,172,400	
クリエートメディック	5,400	970.00	5,238,000	
日機装	54,200	855.00	46,341,000	
日本エム・ディ・エム	10,400	1,576.00	16,390,400	
島津製作所	232,300	4,075.00	946,622,500	
ＪＭＳ	15,300	609.00	9,317,700	
長野計器	13,100	1,365.00	17,881,500	
ブイ・テクノロジー	7,900	3,520.00	27,808,000	
東京計器	11,500	975.00	11,212,500	
愛知時計電機	2,600	5,460.00	14,196,000	
インターアクション	9,000	1,999.00	17,991,000	
オーバル	16,300	246.00	4,009,800	
東京精密	30,500	4,910.00	149,755,000	
マニー	71,900	1,659.00	119,282,100	
ニコン	275,700	1,217.00	335,526,900	
トプコン	84,900	1,485.00	126,076,500	
オリンパス	946,800	2,420.00	2,291,256,000	
理研計器	14,600	5,410.00	78,986,000	
タムロン	14,000	2,596.00	36,344,000	
ＨＯＹＡ	352,300	15,235.00	5,367,290,500	
シード	8,500	532.00	4,522,000	
ノーリツ鋼機	16,200	2,306.00	37,357,200	
エー・アンド・デイ	16,500	1,037.00	17,110,500	
朝日インテック	197,900	2,086.00	412,819,400	
シチズン時計	211,500	499.00	105,538,500	

リズム	5,700	1,226.00	6,988,200	
大研医器	14,300	521.00	7,450,300	
メニコン	59,900	2,816.00	168,678,400	
シンシア	2,000	511.00	1,022,000	
松風	7,500	1,832.00	13,740,000	
セイコーホールディングス	25,500	2,109.00	53,779,500	
ニプロ	134,600	1,069.00	143,887,400	
中本パックス	5,000	1,683.00	8,415,000	
スノーピーク	23,500	2,364.00	55,554,000	
パラマウントベッドホールディングス	34,600	1,977.00	68,404,200	
トランザクション	9,900	1,073.00	10,622,700	
粧美堂	5,300	394.00	2,088,200	
ニホンフラッシュ	15,500	1,014.00	15,717,000	
前田工繊	19,900	3,540.00	70,446,000	
永大産業	23,600	288.00	6,796,800	
アートネイチャー	15,400	688.00	10,595,200	
バンダイナムコホールディングス	161,800	8,058.00	1,303,784,400	
アイフィスジャパン	4,600	668.00	3,072,800	
共立印刷	30,200	134.00	4,046,800	
ＳＨＯＥＩ	16,900	4,245.00	71,740,500	
フランスベッドホールディングス	23,200	874.00	20,276,800	
パイロットコーポレーション	30,500	4,040.00	123,220,000	
萩原工業	11,700	1,198.00	14,016,600	
フジシールインターナショナル	43,800	2,198.00	96,272,400	
タカラトミー	75,600	1,114.00	84,218,400	
広済堂ホールディングス	11,200	752.00	8,422,400	
エステールホールディングス	4,500	632.00	2,844,000	
タカノ	6,200	680.00	4,216,000	
プロネクサス	14,000	1,066.00	14,924,000	
ホクシン	12,700	158.00	2,006,600	
ウッドワン	5,500	1,013.00	5,571,500	
大建工業	10,600	2,069.00	21,931,400	
凸版印刷	274,400	2,163.00	593,527,200	
大日本印刷	213,400	2,806.00	598,800,400	
共同印刷	5,500	2,680.00	14,740,000	
ＮＩＳＳＨＡ	37,100	1,503.00	55,761,300	

光村印刷	1,600	1,366.00	2,185,600	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,800	1,776.00	15,628,800	
アシックス	159,600	2,214.00	353,354,400	
ツツミ	4,500	1,787.00	8,041,500	
ローランド	12,500	4,185.00	52,312,500	
小松ウオール工業	5,500	1,872.00	10,296,000	
ヤマハ	107,400	5,230.00	561,702,000	
河合楽器製作所	5,100	3,110.00	15,861,000	
クリナップ	16,800	525.00	8,820,000	
ピジョン	109,100	2,283.00	249,075,300	
兼松サステック	1,200	1,615.00	1,938,000	
キングジム	14,500	875.00	12,687,500	
リンテック	38,700	2,675.00	103,522,500	
イトーキ	33,300	340.00	11,322,000	
任天堂	101,900	54,780.00	5,582,082,000	
三菱鉛筆	29,700	1,189.00	35,313,300	
タカラスタンダード	37,300	1,351.00	50,392,300	
コクヨ	86,600	1,671.00	144,708,600	
ナカバヤシ	16,100	503.00	8,098,300	
グローブライド	16,100	2,883.00	46,416,300	
オカムラ	62,000	1,190.00	73,780,000	
美津濃	17,900	2,167.00	38,789,300	
東京電力ホールディングス	1,351,200	291.00	393,199,200	
中部電力	552,300	1,223.00	675,462,900	
関西電力	684,000	1,092.00	746,928,000	
中国電力	282,100	954.00	269,123,400	
北陸電力	165,100	582.00	96,088,200	
東北電力	422,800	809.00	342,045,200	
四国電力	162,600	803.00	130,567,800	
九州電力	372,100	847.00	315,168,700	
北海道電力	156,900	503.00	78,920,700	
沖縄電力	38,300	1,404.00	53,773,200	
電源開発	153,900	1,475.00	227,002,500	
エフオン	10,900	541.00	5,896,900	
イーレックス	26,600	1,582.00	42,081,200	
レノバ	35,200	1,587.00	55,862,400	

東京瓦斯	346,100	2,192.00	758,651,200	
大阪瓦斯	327,000	1,922.00	628,494,000	
東邦瓦斯	82,900	2,920.00	242,068,000	
北海道瓦斯	8,900	1,487.00	13,234,300	
広島ガス	34,400	359.00	12,349,600	
西部ガスホールディングス	20,300	2,126.00	43,157,800	
静岡ガス	47,000	965.00	45,355,000	
メタウォーター	20,200	1,876.00	37,895,200	
ＳＢＳホールディングス	13,400	3,570.00	47,838,000	
東武鉄道	176,400	2,647.00	466,930,800	
相鉄ホールディングス	57,800	2,105.00	121,669,000	
東急	455,300	1,501.00	683,405,300	
京浜急行電鉄	231,900	1,164.00	269,931,600	
小田急電鉄	268,500	2,053.00	551,230,500	
京王電鉄	93,700	5,160.00	483,492,000	
京成電鉄	125,600	3,020.00	379,312,000	
富士急行	21,500	3,985.00	85,677,500	
新京成電鉄	4,200	2,008.00	8,433,600	
東日本旅客鉄道	317,800	6,645.00	2,111,781,000	
西日本旅客鉄道	218,800	4,798.00	1,049,802,400	
東海旅客鉄道	150,100	14,760.00	2,215,476,000	
西武ホールディングス	235,700	1,099.00	259,034,300	
鴻池運輸	28,700	1,146.00	32,890,200	
西日本鉄道	50,000	2,541.00	127,050,000	
ハマキョウレックス	12,800	2,839.00	36,339,200	
サカイ引越センター	8,300	4,310.00	35,773,000	
近鉄グループホールディングス	171,000	3,325.00	568,575,000	
阪急阪神ホールディングス	213,800	3,270.00	699,126,000	
南海電気鉄道	76,300	2,224.00	169,691,200	
京阪ホールディングス	76,100	2,732.00	207,905,200	
神戸電鉄	4,100	3,125.00	12,812,500	
名古屋鉄道	140,600	1,833.00	257,719,800	
山陽電気鉄道	13,100	1,970.00	25,807,000	
アルプス物流	11,900	1,017.00	12,102,300	
ヤマトホールディングス	239,600	2,378.00	569,768,800	
山九	45,000	4,640.00	208,800,000	

丸運	9,700	241.00	2,337,700	
丸全昭和運輸	13,900	3,110.00	43,229,000	
センコーグループホールディングス	85,700	920.00	78,844,000	
トナミホールディングス	4,100	3,620.00	14,842,000	
ニッコンホールディングス	57,400	2,108.00	120,999,200	
日本石油輸送	1,900	2,608.00	4,955,200	
福山通運	28,100	3,635.00	102,143,500	
セイノーホールディングス	116,400	1,107.00	128,854,800	
エスライン	5,100	880.00	4,488,000	
神奈川中央交通	4,200	3,305.00	13,881,000	
日立物流	33,000	5,230.00	172,590,000	
丸和運輸機関	36,100	1,435.00	51,803,500	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	17,300	1,381.00	23,891,300	
九州旅客鉄道	132,300	2,369.00	313,418,700	
ＳＧホールディングス	323,100	2,512.00	811,627,200	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	59,200	6,980.00	413,216,000	
日本郵船	143,300	8,550.00	1,225,215,000	
商船三井	95,000	8,280.00	786,600,000	
川崎汽船	52,700	6,610.00	348,347,000	
ＮＳユナイテッド海運	10,200	3,040.00	31,008,000	
飯野海運	84,600	526.00	44,499,600	
共栄タンカー	6,400	873.00	5,587,200	
乾汽船	11,700	2,336.00	27,331,200	
日本航空	392,000	2,128.00	834,176,000	
ＡＮＡホールディングス	434,300	2,360.00	1,024,948,000	
パスコ	3,200	1,304.00	4,172,800	
トランコム	4,800	8,410.00	40,368,000	
日新	13,600	1,594.00	21,678,400	
三菱倉庫	54,200	2,725.00	147,695,000	
三井倉庫ホールディングス	18,100	2,335.00	42,263,500	
住友倉庫	60,400	1,966.00	118,746,400	
澁澤倉庫	10,200	2,110.00	21,522,000	
東陽倉庫	28,700	309.00	8,868,300	
日本トランスシティ	37,600	628.00	23,612,800	
ケイヒン	3,000	1,365.00	4,095,000	

中央倉庫	10,400	957.00	9,952,800	
川西倉庫	3,100	1,067.00	3,307,700	
安田倉庫	14,000	951.00	13,314,000	
ファイズホールディングス	3,600	552.00	1,987,200	
東洋埠頭	5,200	1,418.00	7,373,600	
上組	94,000	2,205.00	207,270,000	
サンリツ	4,700	841.00	3,952,700	
キムラユニティー	4,500	1,269.00	5,710,500	
キユーソー流通システム	8,500	854.00	7,259,000	
近鉄エクスプレス	32,300	2,793.00	90,213,900	
東海運	9,700	305.00	2,958,500	
エーアイテイー	10,700	1,461.00	15,632,700	
内外トランスライン	6,600	1,899.00	12,533,400	
日本コンセプト	5,400	1,505.00	8,127,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	58,700	1,797.00	105,483,900	
クロスキャット	4,800	1,440.00	6,912,000	
システナ	253,200	372.00	94,190,400	
デジタルアーツ	9,500	6,810.00	64,695,000	
日鉄ソリューションズ	25,700	3,420.00	87,894,000	
キューブシステム	9,100	934.00	8,499,400	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	2,600	1,550.00	4,030,000	
コア	7,600	1,505.00	11,438,000	
ラクーンホールディングス	12,700	1,248.00	15,849,600	
ソリトンシステムズ	9,000	1,348.00	12,132,000	
ソフトクリエイトホールディングス	7,800	3,810.00	29,718,000	
ＴＩＳ	169,000	3,040.00	513,760,000	
ＪＮＳホールディングス	8,200	410.00	3,362,000	
グリー	108,900	932.00	101,494,800	
ＧＭＯペパボ	1,900	2,280.00	4,332,000	
コーエーテクモホールディングス	56,600	4,210.00	238,286,000	
三菱総合研究所	7,600	3,875.00	29,450,000	
電算	2,000	2,274.00	4,548,000	
ＡＧＳ	9,200	840.00	7,728,000	
ファインデックス	15,100	938.00	14,163,800	
ブレインパッド	13,900	1,161.00	16,137,900	
ＫＬａｂ	32,500	460.00	14,950,000	

ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	25,900	925.00	23,957,500	
ネクソン	399,600	2,080.00	831,168,000	
アイスタイル	54,800	218.00	11,946,400	
エムアップホールディングス	20,600	776.00	15,985,600	
エイチーム	12,400	752.00	9,324,800	
エニグモ	19,400	631.00	12,241,400	
テクノスジャパン	14,100	502.00	7,078,200	
コロプラ	58,500	676.00	39,546,000	
ブロードリーフ	88,200	365.00	32,193,000	
クロス・マーケティンググループ	6,900	885.00	6,106,500	
デジタルハーツホールディングス	8,100	1,848.00	14,968,800	
システム情報	13,500	893.00	12,055,500	
メディアドゥ	6,300	2,907.00	18,314,100	
じげん	50,700	293.00	14,855,100	
ブイキューブ	18,200	822.00	14,960,400	
エンカレッジ・テクノロジ	4,200	559.00	2,347,800	
サイバーリンクス	6,100	903.00	5,508,300	
フィックスターズ	19,100	787.00	15,031,700	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,200	1,937.00	13,946,400	
オプティム	12,500	1,086.00	13,575,000	
セレス	6,600	2,063.00	13,615,800	
ＳＨＩＦＴ	9,000	20,740.00	186,660,000	
ティーガイア	15,800	1,648.00	26,038,400	
セック	2,700	2,224.00	6,004,800	
テクマトリックス	30,000	1,562.00	46,860,000	
プロシップ	6,000	1,432.00	8,592,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	48,100	2,496.00	120,057,600	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	34,300	10,740.00	368,382,000	
ザッパラス	7,200	487.00	3,506,400	
システムリサーチ	5,300	1,776.00	9,412,800	
インターネットイニシアティブ	47,200	4,100.00	193,520,000	
さくらインターネット	19,300	529.00	10,209,700	
ヴィンクス	5,200	897.00	4,664,400	
ＧＭＯグローバルサイン・ホールディングス	4,000	3,605.00	14,420,000	
ＳＲＡホールディングス	8,600	2,781.00	23,916,600	

システムインテグレータ	5,900	524.00	3,091,600	
朝日ネット	16,500	593.00	9,784,500	
ｅＢＡＳＥ	21,500	537.00	11,545,500	
アバント	19,100	1,030.00	19,673,000	
アドソル日進	6,400	1,688.00	10,803,200	
ＯＤＫソリューションズ	4,000	638.00	2,552,000	
フリービット	10,700	889.00	9,512,300	
コムチュア	19,900	2,924.00	58,187,600	
サイバーコム	2,900	1,037.00	3,007,300	
アステリア	12,900	892.00	11,506,800	
アイル	10,000	1,302.00	13,020,000	
マークラインズ	9,000	2,655.00	23,895,000	
メディカル・データ・ビジョン	22,600	1,123.00	25,379,800	
ｇｕｍｉ	24,800	604.00	14,979,200	
ショーケース	4,200	476.00	1,999,200	
モバイルファクトリー	4,200	829.00	3,481,800	
テラスカイ	6,600	1,480.00	9,768,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,000	1,213.00	9,704,000	
ＰＣＩホールディングス	8,100	1,086.00	8,796,600	
パイプドHD	3,300	2,337.00	7,712,100	
アイビーシー	3,200	665.00	2,128,000	
ネオジャパン	5,100	1,100.00	5,610,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,800	2,978.00	11,316,400	
ラクス	61,000	2,547.00	155,367,000	
ランドコンピュータ	4,300	834.00	3,586,200	
ダブルスタンダード	5,400	2,536.00	13,694,400	
オープンドア	10,600	1,655.00	17,543,000	
マイネット	6,300	501.00	3,156,300	
アカツキ	8,000	2,762.00	22,096,000	
ベネフィットジャパン	1,400	2,175.00	3,045,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,700	2,125.00	9,987,500	
カナミックネットワーク	19,300	439.00	8,472,700	
ノムラシステムコーポレーション	9,900	256.00	2,534,400	
チェンジ	32,800	1,517.00	49,757,600	
シンクロ・フード	9,600	301.00	2,889,600	
オークネット	9,500	1,542.00	14,649,000	

キャピタル・アセット・プランニング	3,800	722.00	2,743,600	
セグエグループ	4,800	690.00	3,312,000	
エイトレッド	2,600	2,255.00	5,863,000	
マクロミル	36,400	1,100.00	40,040,000	
ビーグリー	4,300	1,157.00	4,975,100	
オロ	5,700	2,319.00	13,218,300	
ユーザーローカル	5,500	1,552.00	8,536,000	
テモナ	4,200	410.00	1,722,000	
ニーズウェル	4,300	607.00	2,610,100	
マネーフォワード	27,000	4,890.00	132,030,000	
サインポスト	5,700	928.00	5,289,600	
電算システムホールディングス	7,300	2,651.00	19,352,300	
ソルクシーズ	15,500	412.00	6,386,000	
フェイス	5,200	652.00	3,390,400	
プロトコーポレーション	18,900	1,323.00	25,004,700	
ハイマックス	4,900	1,118.00	5,478,200	
野村総合研究所	342,300	4,375.00	1,497,562,500	
サイバネットシステム	12,900	644.00	8,307,600	
ＣＥホールディングス	9,800	471.00	4,615,800	
日本システム技術	3,600	2,237.00	8,053,200	
インテージホールディングス	22,200	1,720.00	38,184,000	
東邦システムサイエンス	4,900	973.00	4,767,700	
ソースネクスト	77,400	161.00	12,461,400	
インフォコム	19,500	1,954.00	38,103,000	
シンプレクス・ホールディングス	19,000	2,362.00	44,878,000	
ＨＥＲＯＺ	5,200	1,118.00	5,813,600	
ラクスル	19,400	4,265.00	82,741,000	
ＩＰＳ	5,000	1,900.00	9,500,000	
ＦＩＧ	19,800	273.00	5,405,400	
システムサポート	5,400	1,007.00	5,437,800	
イーソル	11,100	573.00	6,360,300	
アルテリア・ネットワークス	22,500	1,379.00	31,027,500	
ＥｄｕＬａｂ	1,700	805.00	1,368,500	
東海ソフト	3,000	919.00	2,757,000	
ウイングアーク１ｓｔ	10,200	1,460.00	14,892,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	4,100	2,158.00	8,847,800	

ス				
サーバーワークス	3,100	2,570.00	7,967,000	
東名	1,800	907.00	1,632,600	
ヴィッツ	1,800	1,333.00	2,399,400	
トビラシステムズ	3,800	753.00	2,861,400	
Ｓａｎｓａｎ	63,100	1,662.00	104,872,200	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,400	776.00	2,638,400	
ギフティ	16,100	1,395.00	22,459,500	
ベース	3,100	3,975.00	12,322,500	
ＪＭＤＣ	16,600	5,630.00	93,458,000	
フォーカスシステムズ	12,100	910.00	11,011,000	
クレスコ	13,000	1,762.00	22,906,000	
フジ・メディア・ホールディングス	170,800	1,166.00	199,152,800	
オービック	55,800	18,530.00	1,033,974,000	
ジャストシステム	25,200	5,070.00	127,764,000	
ＴＤＣソフト	15,700	1,045.00	16,406,500	
Ｚホールディングス	2,575,200	571.10	1,470,696,720	
トレンドマイクロ	94,700	5,860.00	554,942,000	
ＩＤホールディングス	11,400	843.00	9,610,200	
日本オラクル	36,000	8,860.00	318,960,000	
アルファシステムズ	4,800	3,655.00	17,544,000	
フューチャー	37,500	1,561.00	58,537,500	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	10,500	1,351.00	14,185,500	
ＳＢテクノロジー	7,700	2,343.00	18,041,100	
トーセ	5,100	702.00	3,580,200	
オービックビジネスコンサルタント	16,900	4,330.00	73,177,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	80,800	3,345.00	270,276,000	
アイティフォー	21,700	779.00	16,904,300	
東計電算	2,100	4,585.00	9,628,500	
エックスネット	3,000	959.00	2,877,000	
大塚商会	95,900	4,855.00	465,594,500	
サイボウズ	23,800	1,490.00	35,462,000	
電通国際情報サービス	25,600	3,375.00	86,400,000	
ＡＣＣＥＳＳ	20,300	602.00	12,220,600	
デジタルガレージ	29,300	4,435.00	129,945,500	
ＥＭシステムズ	29,500	641.00	18,909,500	

ウェザーニューズ	5,300	7,690.00	40,757,000	
ＣＩＪ	11,700	818.00	9,570,600	
ビジネスエンジニアリング	2,100	3,490.00	7,329,000	
日本エンタープライズ	19,000	171.00	3,249,000	
WOWOW	8,600	1,679.00	14,439,400	
スカラ	16,100	648.00	10,432,800	
インテリジェント　ウェイブ	10,700	523.00	5,596,100	
ＩMAGＩCA　GROUP	15,400	613.00	9,440,200	
ネットワンシステムズ	67,500	2,788.00	188,190,000	
システムソフト	39,700	105.00	4,168,500	
アルゴグラフィックス	13,800	3,260.00	44,988,000	
マーベラス	28,200	727.00	20,501,400	
エイベックス	30,700	1,330.00	40,831,000	
日本ユニシス	55,400	3,105.00	172,017,000	
兼松エレクトロニクス	9,700	3,790.00	36,763,000	
都築電気	9,200	1,587.00	14,600,400	
ＴＢＳホールディングス	107,800	1,695.00	182,721,000	
日本テレビホールディングス	148,000	1,219.00	180,412,000	
朝日放送グループホールディングス	17,900	691.00	12,368,900	
テレビ朝日ホールディングス	42,700	1,488.00	63,537,600	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	150,500	431.00	64,865,500	
テレビ東京ホールディングス	12,800	1,993.00	25,510,400	
日本ＢＳ放送	6,200	1,104.00	6,844,800	
ビジョン	30,400	1,015.00	30,856,000	
スマートバリュー	5,000	494.00	2,470,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	16,900	2,696.00	45,562,400	
ワイヤレスゲート	7,800	326.00	2,542,800	
コネクシオ	12,700	1,396.00	17,729,200	
クロップス	3,400	934.00	3,175,600	
日本電信電話	1,853,400	3,250.00	6,023,550,000	
ＫＤＤＩ	1,291,600	3,582.00	4,626,511,200	
ソフトバンク	2,683,400	1,445.00	3,877,513,000	
光通信	20,900	15,500.00	323,950,000	
エムティーアイ	17,500	559.00	9,782,500	
GMOインターネット	62,800	2,565.00	161,082,000	
ファイバーゲート	5,900	1,090.00	6,431,000	

アイドママーケティングコミュニケーション	4,500	282.00	1,269,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	96,800	2,496.00	241,612,800	
学研ホールディングス	25,200	1,048.00	26,409,600	
ゼンリン	29,100	972.00	28,285,200	
昭文社ホールディングス	7,600	414.00	3,146,400	
インプレスホールディングス	14,700	214.00	3,145,800	
アイネット	9,200	1,271.00	11,693,200	
松竹	11,700	11,620.00	135,954,000	
東宝	104,600	4,540.00	474,884,000	
東映	5,800	15,590.00	90,422,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	471,800	2,297.00	1,083,724,600	
ピー・シー・エー	10,500	1,676.00	17,598,000	
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,689.00	10,302,900	
ＤＴＳ	34,000	2,573.00	87,482,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	82,500	5,680.00	468,600,000	
シーイーシー	19,100	1,039.00	19,844,900	
カプコン	167,100	2,637.00	440,642,700	
アイ・エス・ビー	8,500	936.00	7,956,000	
ジャステック	10,400	1,028.00	10,691,200	
ＳＣＳＫ	122,700	2,023.00	248,222,100	
日本システムウエア	6,800	2,154.00	14,647,200	
アイネス	16,200	1,540.00	24,948,000	
ＴＫＣ	30,000	3,040.00	91,200,000	
富士ソフト	18,900	5,070.00	95,823,000	
ＮＳＤ	57,000	1,998.00	113,886,000	
コナミホールディングス	64,400	5,650.00	363,860,000	
福井コンピュータホールディングス	8,200	3,020.00	24,764,000	
ＪＢＣＣホールディングス	12,100	1,672.00	20,231,200	
ミロク情報サービス	15,700	1,246.00	19,562,200	
ソフトバンクグループ	1,062,400	5,527.00	5,871,884,800	
ホウスイ	1,500	822.00	1,233,000	
高千穂交易	6,900	1,492.00	10,294,800	
オルバヘルスケアホールディングス	2,900	1,359.00	3,941,100	
伊藤忠食品	4,300	4,755.00	20,446,500	
エレマテック	14,300	1,031.00	14,743,300	
ＪＡＬＵＸ	5,000	2,546.00	12,730,000	

あらた	14,200	4,020.00	57,084,000	
トーメンデバイス	2,700	6,640.00	17,928,000	
東京エレクトロン　デバイス	5,300	5,800.00	30,740,000	
フィールズ	15,600	492.00	7,675,200	
双日	196,400	1,775.00	348,610,000	
アルフレッサ　ホールディングス	197,600	1,567.00	309,639,200	
横浜冷凍	49,900	830.00	41,417,000	
ラサ商事	9,400	959.00	9,014,600	
アルコニックス	22,100	1,277.00	28,221,700	
神戸物産	138,000	3,655.00	504,390,000	
ハイパー	4,500	487.00	2,191,500	
あい　ホールディングス	25,400	1,818.00	46,177,200	
ディーブイエックス	6,100	1,037.00	6,325,700	
ダイワボウホールディングス	86,400	1,701.00	146,966,400	
マクニカ・富士エレホールディングス	42,400	2,491.00	105,618,400	
ラクト・ジャパン	6,100	1,976.00	12,053,600	
グリムス	7,900	2,124.00	16,779,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,900	776.00	23,978,400	
八洲電機	12,900	941.00	12,138,900	
メディアスホールディングス	10,100	837.00	8,453,700	
レスターホールディングス	16,900	1,920.00	32,448,000	
ジューテックホールディングス	4,100	1,208.00	4,952,800	
大光	6,800	673.00	4,576,400	
ＯＣＨＩホールディングス	5,200	1,306.00	6,791,200	
ＴＯＫＡＩホールディングス	86,200	857.00	73,873,400	
黒谷	4,900	660.00	3,234,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3,100	729.00	2,259,900	
三洋貿易	17,900	987.00	17,667,300	
ビューティガレージ	2,900	2,919.00	8,465,100	
ウイン・パートナーズ	12,900	944.00	12,177,600	
ミタチ産業	4,900	984.00	4,821,600	
シップヘルスケアホールディングス	57,000	2,567.00	146,319,000	
明治電機工業	5,600	1,242.00	6,955,200	
デリカフーズホールディングス	6,900	577.00	3,981,300	
スターティアホールディングス	4,100	778.00	3,189,800	
コメダホールディングス	38,800	2,029.00	78,725,200	

ピーバンドットコム	2,500	515.00	1,287,500	
アセンテック	6,100	770.00	4,697,000	
富士興産	4,500	1,025.00	4,612,500	
協栄産業	1,800	1,630.00	2,934,000	
フルサト・マルカホールディングス	17,100	2,332.00	39,877,200	
ヤマエグループホールディングス	12,000	1,042.00	12,504,000	
小野建	17,200	1,621.00	27,881,200	
南陽	3,600	1,900.00	6,840,000	
佐鳥電機	11,100	942.00	10,456,200	
エコートレーディング	3,800	606.00	2,302,800	
伯東	10,800	2,437.00	26,319,600	
コンドーテック	13,700	992.00	13,590,400	
中山福	9,500	350.00	3,325,000	
ナガイレーベン	23,600	2,098.00	49,512,800	
三菱食品	17,100	2,752.00	47,059,200	
松田産業	13,000	2,326.00	30,238,000	
第一興商	33,800	3,315.00	112,047,000	
メディパルホールディングス	191,900	2,044.00	392,243,600	
ＳＰＫ	7,100	1,305.00	9,265,500	
萩原電気ホールディングス	6,600	1,989.00	13,127,400	
アズワン	25,500	5,840.00	148,920,000	
スズデン	6,200	1,711.00	10,608,200	
尾家産業	4,900	995.00	4,875,500	
シモジマ	10,900	1,042.00	11,357,800	
ドウシシャ	16,800	1,494.00	25,099,200	
小津産業	3,900	1,935.00	7,546,500	
高速	10,600	1,459.00	15,465,400	
たけびし	6,700	1,411.00	9,453,700	
リックス	4,000	1,496.00	5,984,000	
丸文	15,800	773.00	12,213,400	
ハピネット	14,900	1,466.00	21,843,400	
橋本総業ホールディングス	3,600	1,984.00	7,142,400	
日本ライフライン	52,700	1,060.00	55,862,000	
タカショー	13,600	700.00	9,520,000	
ＩＤＯＭ	54,000	687.00	37,098,000	
進和	10,500	2,019.00	21,199,500	

エスケイジャパン	4,400	429.00	1,887,600	
ダイトロン	7,500	2,005.00	15,037,500	
シークス	25,500	1,321.00	33,685,500	
田中商事	5,500	632.00	3,476,000	
オーハシテクニカ	9,900	1,349.00	13,355,100	
白銅	5,700	2,706.00	15,424,200	
ダイコー通産	2,100	1,134.00	2,381,400	
伊藤忠商事	1,243,700	3,648.00	4,537,017,600	
丸紅	1,754,000	1,163.50	2,040,779,000	
高島	2,700	2,335.00	6,304,500	
長瀬産業	97,600	1,802.00	175,875,200	
蝶理	10,000	1,766.00	17,660,000	
豊田通商	178,600	4,955.00	884,963,000	
三共生興	23,600	550.00	12,980,000	
兼松	66,300	1,255.00	83,206,500	
ツカモトコーポレーション	3,000	1,300.00	3,900,000	
三井物産	1,380,900	2,860.50	3,950,064,450	
日本紙パルプ商事	9,300	3,935.00	36,595,500	
カメイ	21,100	1,018.00	21,479,800	
東都水産	900	3,950.00	3,555,000	
ＯＵＧホールディングス	2,600	2,742.00	7,129,200	
スターゼン	13,200	1,969.00	25,990,800	
山善	74,800	992.00	74,201,600	
椿本興業	3,700	4,110.00	15,207,000	
住友商事	1,122,300	1,746.50	1,960,096,950	
内田洋行	7,600	4,560.00	34,656,000	
三菱商事	1,332,500	3,891.00	5,184,757,500	
第一実業	8,100	4,380.00	35,478,000	
キヤノンマーケティングジャパン	44,100	2,240.00	98,784,000	
西華産業	9,400	1,594.00	14,983,600	
佐藤商事	14,700	1,118.00	16,434,600	
菱洋エレクトロ	10,500	2,368.00	24,864,000	
東京産業	16,100	724.00	11,656,400	
ユアサ商事	16,900	2,865.00	48,418,500	
神鋼商事	4,000	3,275.00	13,100,000	
トルク	9,600	198.00	1,900,800	

阪和興業	35,600	3,210.00	114,276,000	
正栄食品工業	11,500	3,845.00	44,217,500	
カナデン	14,500	996.00	14,442,000	
菱電商事	14,100	1,676.00	23,631,600	
岩谷産業	42,700	5,790.00	247,233,000	
ナイス	6,100	1,714.00	10,455,400	
ニチモウ	2,600	2,522.00	6,557,200	
極東貿易	5,100	2,580.00	13,158,000	
アステナホールディングス	25,100	396.00	9,939,600	
三愛石油	43,800	1,013.00	44,369,400	
稲畑産業	39,200	1,671.00	65,503,200	
ＧＳＩクレオス	8,500	1,180.00	10,030,000	
明和産業	16,400	1,111.00	18,220,400	
クワザワホールディングス	7,100	605.00	4,295,500	
ワキタ	37,900	1,018.00	38,582,200	
東邦ホールディングス	57,100	1,720.00	98,212,000	
サンゲツ	47,000	1,575.00	74,025,000	
ミツウロコグループホールディングス	26,200	1,115.00	29,213,000	
シナネンホールディングス	6,600	3,120.00	20,592,000	
伊藤忠エネクス	39,300	993.00	39,024,900	
サンリオ	54,900	2,292.00	125,830,800	
サンワテクノス	10,800	1,343.00	14,504,400	
リョーサン	19,600	2,196.00	43,041,600	
新光商事	26,700	861.00	22,988,700	
トーホー	8,100	1,072.00	8,683,200	
三信電気	8,200	1,480.00	12,136,000	
東陽テクニカ	17,600	1,062.00	18,691,200	
モスフードサービス	23,300	2,980.00	69,434,000	
加賀電子	16,100	2,995.00	48,219,500	
ソーダニッカ	18,300	815.00	14,914,500	
立花エレテック	14,200	1,520.00	21,584,000	
フォーバル	7,800	872.00	6,801,600	
ＰＡＬＴＡＣ	24,900	4,080.00	101,592,000	
三谷産業	20,900	308.00	6,437,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4,000	2,959.00	11,836,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	2,020.00	3,232,000	

コーア商事ホールディングス	13,400	593.00	7,946,200	
国際紙パルプ商事	37,100	308.00	11,426,800	
ヤマタネ	8,300	1,585.00	13,155,500	
丸紅建材リース	1,600	1,770.00	2,832,000	
日鉄物産	12,700	5,110.00	64,897,000	
泉州電業	5,000	6,160.00	30,800,000	
トラスコ中山	37,000	2,510.00	92,870,000	
オートバックスセブン	59,800	1,357.00	81,148,600	
モリト	13,000	668.00	8,684,000	
加藤産業	25,700	3,210.00	82,497,000	
北恵	4,500	852.00	3,834,000	
イノテック	10,800	1,443.00	15,584,400	
イエローハット	30,800	1,572.00	48,417,600	
ＪＫホールディングス	14,300	1,075.00	15,372,500	
日伝	14,800	2,164.00	32,027,200	
北沢産業	12,200	231.00	2,818,200	
杉本商事	8,300	2,130.00	17,679,000	
因幡電機産業	47,500	2,649.00	125,827,500	
東テク	5,900	2,385.00	14,071,500	
ミスミグループ本社	223,100	3,850.00	858,935,000	
アルテック	12,100	249.00	3,012,900	
タキヒヨー	5,400	1,379.00	7,446,600	
蔵王産業	3,400	1,781.00	6,055,400	
スズケン	69,500	3,270.00	227,265,000	
ジェコス	12,300	797.00	9,803,100	
グローセル	20,800	398.00	8,278,400	
ローソン	39,400	4,870.00	191,878,000	
サンエー	13,500	4,000.00	54,000,000	
カワチ薬品	14,000	2,174.00	30,436,000	
エービーシー・マート	27,800	5,240.00	145,672,000	
ハードオフコーポレーション	8,400	720.00	6,048,000	
アスクル	29,000	1,328.00	38,512,000	
ゲオホールディングス	24,100	1,156.00	27,859,600	
アダストリア	19,400	1,604.00	31,117,600	
くら寿司	18,700	3,505.00	65,543,500	
キャンドゥ	8,600	2,218.00	19,074,800	

アイケイ	6,100	376.00	2,293,600	
パルグループホールディングス	15,800	1,588.00	25,090,400	
エディオン	82,000	1,063.00	87,166,000	
サーラコーポレーション	36,700	623.00	22,864,100	
ワッツ	9,200	691.00	6,357,200	
ハローズ	8,200	2,801.00	22,968,200	
フジオフードグループ本社	15,000	1,249.00	18,735,000	
あみやき亭	4,400	2,867.00	12,614,800	
大黒天物産	5,800	4,615.00	26,767,000	
ハニーズホールディングス	14,500	1,001.00	14,514,500	
ファーマライズホールディングス	4,900	701.00	3,434,900	
アルペン	13,800	1,985.00	27,393,000	
ハブ	6,300	561.00	3,534,300	
クオールホールディングス	22,100	1,285.00	28,398,500	
ジンズホールディングス	12,200	7,070.00	86,254,000	
ビックカメラ	105,900	988.00	104,629,200	
ＤＣＭホールディングス	110,100	1,059.00	116,595,900	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	225,000	2,061.00	463,725,000	
東京一番フーズ	5,200	586.00	3,047,200	
きちりホールディングス	4,700	358.00	1,682,600	
アークランドサービスホールディングス	13,200	2,140.00	28,248,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	212,700	1,025.00	218,017,500	
ドトール・日レスホールディングス	30,900	1,560.00	48,204,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	109,400	3,820.00	417,908,000	
ブロンコビリー	10,300	2,194.00	22,598,200	
ＺＯＺＯ	122,400	2,886.00	353,246,400	
トレジャー・ファクトリー	5,600	825.00	4,620,000	
物語コーポレーション	9,500	6,140.00	58,330,000	
三越伊勢丹ホールディングス	311,800	891.00	277,813,800	
Ｈａｍｅｅ	4,900	1,078.00	5,282,200	
マーケットエンタープライズ	1,700	668.00	1,135,600	
ウエルシアホールディングス	94,100	3,115.00	293,121,500	
クリエイトＳＤホールディングス	26,300	3,055.00	80,346,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	20,800	356.00	7,404,800	
ミサワ	4,200	715.00	3,003,000	
ティーライフ	2,700	1,355.00	3,658,500	

チムニー	5,400	1,134.00	6,123,600	
シュッピン	15,200	1,178.00	17,905,600	
オイシックス・ラ・大地	25,700	2,683.00	68,953,100	
ネクステージ	36,100	2,786.00	100,574,600	
ジョイフル本田	52,300	1,504.00	78,659,200	
鳥貴族ホールディングス	6,700	1,743.00	11,678,100	
ホットランド	13,600	1,214.00	16,510,400	
すかいらーくホールディングス	229,800	1,469.00	337,576,200	
ＳＦＰホールディングス	8,700	1,382.00	12,023,400	
綿半ホールディングス	13,700	1,241.00	17,001,700	
ヨシックスホールディングス	3,700	1,922.00	7,111,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	52,000	1,036.00	53,872,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,600	1,082.00	10,387,200	
ＢＥＥＮＯＳ	9,100	1,971.00	17,936,100	
あさひ	15,000	1,365.00	20,475,000	
日本調剤	11,100	1,308.00	14,518,800	
コスモス薬品	18,000	14,780.00	266,040,000	
トーエル	9,100	815.00	7,416,500	
セブン&アイ・ホールディングス	695,700	5,236.00	3,642,685,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	94,700	722.00	68,373,400	
ツルハホールディングス	38,800	9,730.00	377,524,000	
サンマルクホールディングス	14,300	1,452.00	20,763,600	
フェリシモ	4,200	1,124.00	4,720,800	
トリドールホールディングス	44,400	2,287.00	101,542,800	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	17,000	465.00	7,905,000	
ウイルプラスホールディングス	3,200	1,027.00	3,286,400	
ＪＭホールディングス	12,200	1,566.00	19,105,200	
サツドラホールディングス	8,600	620.00	5,332,000	
アレンザホールディングス	13,900	1,054.00	14,650,600	
串カツ田中ホールディングス	4,900	2,049.00	10,040,100	
バロックジャパンリミテッド	12,800	870.00	11,136,000	
クスリのアオキホールディングス	17,700	6,560.00	116,112,000	
力の源ホールディングス	9,100	546.00	4,968,600	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	104,200	3,525.00	367,305,000	
メディカルシステムネットワーク	17,800	522.00	9,291,600	

はるやまホールディングス	9,200	495.00	4,554,000	
ノジマ	28,900	2,291.00	66,209,900	
カッパ・クリエイト	24,900	1,327.00	33,042,300	
ライトオン	13,300	695.00	9,243,500	
良品計画	204,800	1,535.00	314,368,000	
三城ホールディングス	23,800	229.00	5,450,200	
アドヴァングループ	18,500	971.00	17,963,500	
アルビス	5,900	2,150.00	12,685,000	
コナカ	21,000	336.00	7,056,000	
ハウス　オブ　ローゼ	2,400	1,670.00	4,008,000	
Ｇ－７ホールディングス	20,000	1,430.00	28,600,000	
イオン北海道	31,400	1,100.00	34,540,000	
コジマ	31,300	523.00	16,369,900	
ヒマラヤ	6,600	982.00	6,481,200	
コーナン商事	25,400	3,325.00	84,455,000	
エコス	6,700	1,968.00	13,185,600	
ワタミ	21,500	877.00	18,855,500	
マルシェ	4,300	399.00	1,715,700	
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	355,700	1,484.00	527,858,800	
西松屋チェーン	39,300	1,378.00	54,155,400	
ゼンショーホールディングス	87,000	2,723.00	236,901,000	
幸楽苑ホールディングス	11,300	1,348.00	15,232,400	
ハークスレイ	8,300	433.00	3,593,900	
サイゼリヤ	26,500	2,639.00	69,933,500	
ＶＴホールディングス	67,800	450.00	30,510,000	
魚力	5,100	2,003.00	10,215,300	
フジ・コーポレーション	9,700	1,125.00	10,912,500	
ユナイテッドアローズ	18,800	1,822.00	34,253,600	
ハイデイ日高	25,900	1,628.00	42,165,200	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	12,400	203.00	2,517,200	
コロワイド	73,100	1,642.00	120,030,200	
ピーシーデポコーポレーション	21,900	297.00	6,504,300	
壱番屋	12,600	4,605.00	58,023,000	
ＰＬＡＮＴ	5,100	687.00	3,503,700	
スギホールディングス	35,600	6,780.00	241,368,000	

薬王堂ホールディングス	9,000	2,235.00	20,115,000	
スクロール	27,800	850.00	23,630,000	
ヨンドシーホールディングス	16,600	1,718.00	28,518,800	
木曽路	23,900	2,186.00	52,245,400	
ＳＲＳホールディングス	24,900	767.00	19,098,300	
リテールパートナーズ	21,900	1,230.00	26,937,000	
ケーヨー	33,100	836.00	27,671,600	
上新電機	20,600	2,047.00	42,168,200	
日本瓦斯	86,700	1,497.00	129,789,900	
ロイヤルホールディングス	30,500	1,769.00	53,954,500	
いなげや	22,200	1,361.00	30,214,200	
チヨダ	17,800	735.00	13,083,000	
ライフコーポレーション	16,700	3,060.00	51,102,000	
リンガーハット	21,900	2,199.00	48,158,100	
ＭｒＭａｘＨＤ	22,900	588.00	13,465,200	
ＡＯＫＩホールディングス	35,000	599.00	20,965,000	
オークワ	28,100	891.00	25,037,100	
コメリ	27,600	2,483.00	68,530,800	
青山商事	37,300	678.00	25,289,400	
しまむら	20,700	9,890.00	204,723,000	
はせがわ	11,100	276.00	3,063,600	
高島屋	129,700	1,089.00	141,243,300	
松屋	36,100	726.00	26,208,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	84,500	798.00	67,431,000	
近鉄百貨店	7,000	2,571.00	17,997,000	
丸井グループ	140,500	2,209.00	310,364,500	
アクシアル　リテイリング	13,900	3,170.00	44,063,000	
イオン	684,300	2,457.00	1,681,325,100	
イズミ	32,200	3,125.00	100,625,000	
平和堂	32,900	1,895.00	62,345,500	
フジ	21,600	1,865.00	40,284,000	
ヤオコー	20,200	6,610.00	133,522,000	
ゼビオホールディングス	24,600	881.00	21,672,600	
ケーズホールディングス	164,300	1,089.00	178,922,700	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	9,800	666.00	6,526,800	
日産東京販売ホールディングス	27,900	225.00	6,277,500	

シルバーライフ	3,900	1,065.00	4,153,500	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	7,900	4,145.00	32,745,500	
ナルミヤ・インターナショナル	4,400	1,167.00	5,134,800	
ブックオフグループホールディングス	10,400	1,011.00	10,514,400	
ギフト	2,900	2,321.00	6,730,900	
アインホールディングス	25,900	5,700.00	147,630,000	
元気寿司	5,100	2,433.00	12,408,300	
ヤマダホールディングス	651,200	385.00	250,712,000	
アークランドサカモト	28,100	1,528.00	42,936,800	
ニトリホールディングス	70,600	16,440.00	1,160,664,000	
グルメ杵屋	14,500	977.00	14,166,500	
愛眼	13,000	177.00	2,301,000	
ケーユーホールディングス	9,600	984.00	9,446,400	
吉野家ホールディングス	62,200	2,360.00	146,792,000	
松屋フーズホールディングス	8,700	3,515.00	30,580,500	
サガミホールディングス	27,600	1,026.00	28,317,600	
関西スーパーマーケット	13,800	1,015.00	14,007,000	
王将フードサービス	11,800	5,900.00	69,620,000	
プレナス	20,100	1,950.00	39,195,000	
ミニストップ	13,300	1,407.00	18,713,100	
アークス	34,100	2,078.00	70,859,800	
バローホールディングス	39,500	2,145.00	84,727,500	
ベルク	8,000	5,230.00	41,840,000	
大庄	9,900	988.00	9,781,200	
ファーストリテイリング	23,800	67,640.00	1,609,832,000	
サンドラッグ	67,000	2,905.00	194,635,000	
サックスバー　ホールディングス	17,500	510.00	8,925,000	
ヤマザワ	4,400	1,577.00	6,938,800	
やまや	3,600	2,405.00	8,658,000	
ベルーナ	38,700	712.00	27,554,400	
島根銀行	5,800	557.00	3,230,600	
じもとホールディングス	12,700	652.00	8,280,400	
めぶきフィナンシャルグループ	925,200	250.00	231,300,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,300	1,560.00	34,788,000	
九州フィナンシャルグループ	363,600	431.00	156,711,600	
ゆうちょ銀行	420,300	1,098.00	461,489,400	

富山第一銀行	42,400	297.00	12,592,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,017,000	455.00	462,735,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	116,300	770.00	89,551,000	
三十三フィナンシャルグループ	16,500	1,468.00	24,222,000	
第四北越フィナンシャルグループ	29,000	2,566.00	74,414,000	
ひろぎんホールディングス	262,600	691.00	181,456,600	
おきなわフィナンシャルグループ	16,100	2,220.00	35,742,000	
十六フィナンシャルグループ	23,900	2,209.00	52,795,100	
北國フィナンシャルホールディングス	16,500	2,711.00	44,731,500	
新生銀行	116,200	2,066.00	240,069,200	
あおぞら銀行	99,500	2,573.00	256,013,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,167,300	684.30	7,641,783,390	
りそなホールディングス	2,038,100	483.80	986,032,780	
三井住友トラスト・ホールディングス	336,600	4,045.00	1,361,547,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,232,600	4,158.00	5,125,150,800	
千葉銀行	594,300	705.00	418,981,500	
群馬銀行	342,100	367.00	125,550,700	
武蔵野銀行	26,500	1,790.00	47,435,000	
千葉興業銀行	41,900	269.00	11,271,100	
筑波銀行	69,400	182.00	12,630,800	
七十七銀行	55,900	1,343.00	75,073,700	
青森銀行	13,800	1,852.00	25,557,600	
秋田銀行	11,400	1,646.00	18,764,400	
山形銀行	20,000	900.00	18,000,000	
岩手銀行	11,700	1,881.00	22,007,700	
東邦銀行	148,600	211.00	31,354,600	
東北銀行	8,500	1,003.00	8,525,500	
みちのく銀行	11,400	843.00	9,610,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	150,000	2,129.00	319,350,000	
静岡銀行	433,700	867.00	376,017,900	
スルガ銀行	156,100	478.00	74,615,800	
八十二銀行	401,100	397.00	159,236,700	
山梨中央銀行	19,300	902.00	17,408,600	
大垣共立銀行	35,200	1,966.00	69,203,200	
福井銀行	15,200	1,361.00	20,687,200	
清水銀行	7,300	1,552.00	11,329,600	

富山銀行	3,200	1,933.00	6,185,600	
滋賀銀行	33,500	2,106.00	70,551,000	
南都銀行	27,800	1,914.00	53,209,200	
百五銀行	170,900	345.00	58,960,500	
京都銀行	63,800	5,190.00	331,122,000	
紀陽銀行	62,700	1,400.00	87,780,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	111,100	893.00	99,212,300	
山陰合同銀行	105,600	632.00	66,739,200	
中国銀行	142,300	902.00	128,354,600	
鳥取銀行	5,700	1,156.00	6,589,200	
伊予銀行	235,900	583.00	137,529,700	
百十四銀行	18,900	1,510.00	28,539,000	
四国銀行	27,100	779.00	21,110,900	
阿波銀行	27,300	2,165.00	59,104,500	
大分銀行	10,200	1,882.00	19,196,400	
宮崎銀行	11,100	2,049.00	22,743,900	
佐賀銀行	10,100	1,449.00	14,634,900	
琉球銀行	38,700	773.00	29,915,100	
セブン銀行	528,800	239.00	126,383,200	
みずほフィナンシャルグループ	2,277,300	1,565.50	3,565,113,150	
高知銀行	6,500	751.00	4,881,500	
山口フィナンシャルグループ	207,400	694.00	143,935,600	
長野銀行	5,800	1,187.00	6,884,600	
名古屋銀行	13,300	2,856.00	37,984,800	
北洋銀行	268,400	248.00	66,563,200	
愛知銀行	6,400	4,665.00	29,856,000	
中京銀行	6,400	1,724.00	11,033,600	
大光銀行	6,100	1,337.00	8,155,700	
愛媛銀行	24,900	871.00	21,687,900	
トマト銀行	6,400	1,044.00	6,681,600	
京葉銀行	75,900	465.00	35,293,500	
栃木銀行	86,000	213.00	18,318,000	
北日本銀行	5,500	1,586.00	8,723,000	
東和銀行	31,300	530.00	16,589,000	
福島銀行	20,400	248.00	5,059,200	
大東銀行	8,500	721.00	6,128,500	

トモニホールディングス	137,700	317.00	43,650,900	
フィデアホールディングス	16,300	1,363.00	22,216,900	
池田泉州ホールディングス	204,800	175.00	35,840,000	
ＦＰＧ	60,200	688.00	41,417,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,900	1,061.00	14,747,900	
マーキュリアホールディングス	7,400	520.00	3,848,000	
ＳＢＩホールディングス	219,700	3,115.00	684,365,500	
ジャフコ　グループ	22,700	6,110.00	138,697,000	
大和証券グループ本社	1,333,800	710.50	947,664,900	
野村ホールディングス	2,719,100	512.30	1,392,994,930	
岡三証券グループ	140,500	386.00	54,233,000	
丸三証券	53,200	529.00	28,142,800	
東洋証券	60,000	149.00	8,940,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	205,000	401.00	82,205,000	
光世証券	4,100	490.00	2,009,000	
水戸証券	48,200	277.00	13,351,400	
いちよし証券	33,600	668.00	22,444,800	
松井証券	87,400	801.00	70,007,400	
マネックスグループ	145,400	612.00	88,984,800	
極東証券	24,100	750.00	18,075,000	
岩井コスモホールディングス	17,000	1,368.00	23,256,000	
アイザワ証券グループ	29,500	960.00	28,320,000	
マネーパートナーズグループ	19,800	219.00	4,336,200	
スパークス・グループ	82,800	269.00	22,273,200	
かんぽ生命保険	179,200	2,016.00	361,267,200	
ＳＯＭＰＯホールディングス	292,300	5,274.00	1,541,590,200	
アニコム　ホールディングス	54,700	693.00	37,907,100	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	399,300	3,912.00	1,562,061,600	
第一生命ホールディングス	876,500	2,574.00	2,256,111,000	
東京海上ホールディングス	586,400	6,801.00	3,988,106,400	
Ｔ＆Ｄホールディングス	462,200	1,663.00	768,638,600	
アドバンスクリエイト	8,500	1,016.00	8,636,000	
全国保証	42,600	5,220.00	222,372,000	
あんしん保証	7,000	273.00	1,911,000	
イントラスト	8,200	687.00	5,633,400	

日本モーゲージサービス	10,300	1,076.00	11,082,800	
Ｃａｓａ	6,700	886.00	5,936,200	
アルヒ	26,700	1,128.00	30,117,600	
プレミアグループ	9,100	3,420.00	31,122,000	
クレディセゾン	114,700	1,252.00	143,604,400	
芙蓉総合リース	18,700	7,600.00	142,120,000	
みずほリース	27,600	3,160.00	87,216,000	
東京センチュリー	34,600	5,600.00	193,760,000	
日本証券金融	70,400	930.00	65,472,000	
アイフル	300,100	340.00	102,034,000	
リコーリース	15,900	3,725.00	59,227,500	
イオンフィナンシャルサービス	97,200	1,172.00	113,918,400	
アコム	352,700	322.00	113,569,400	
ジャックス	19,800	3,005.00	59,499,000	
オリエントコーポレーション	485,400	126.00	61,160,400	
オリックス	1,081,200	2,479.00	2,680,294,800	
三菱ＨＣキャピタル	658,600	603.00	397,135,800	
九州リースサービス	9,500	582.00	5,529,000	
日本取引所グループ	451,100	2,364.50	1,066,625,950	
イー・ギャランティ	26,400	1,924.00	50,793,600	
アサックス	9,900	690.00	6,831,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	7,500	2,001.00	15,007,500	
いちご	203,400	290.00	58,986,000	
日本駐車場開発	208,400	135.00	28,134,000	
スター・マイカ・ホールディングス	11,100	1,246.00	13,830,600	
ＳＲＥホールディングス	4,600	4,945.00	22,747,000	
ＡＤワークスグループ	36,000	139.00	5,004,000	
ヒューリック	426,600	1,052.00	448,783,200	
三栄建築設計	8,400	1,570.00	13,188,000	
野村不動産ホールディングス	92,600	2,647.00	245,112,200	
三重交通グループホールディングス	40,400	462.00	18,664,800	
サムティ	29,300	2,090.00	61,237,000	
ディア・ライフ	26,800	522.00	13,989,600	
地主	12,500	1,672.00	20,900,000	
プレサンスコーポレーション	24,000	2,067.00	49,608,000	
ハウスコム	5,000	1,225.00	6,125,000	

日本管理センター	10,600	951.00	10,080,600	
サンセイランディック	8,200	800.00	6,560,000	
フージャースホールディングス	23,300	666.00	15,517,800	
オープンハウスグループ	56,800	5,830.00	331,144,000	
東急不動産ホールディングス	526,700	644.00	339,194,800	
飯田グループホールディングス	149,100	2,598.00	387,361,800	
イーグランド	4,400	1,416.00	6,230,400	
ムゲンエステート	15,900	474.00	7,536,600	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	8,800	822.00	7,233,600	
シーアールイー	6,200	1,649.00	10,223,800	
ケイアイスター不動産	8,200	7,140.00	58,548,000	
グッドコムアセット	9,500	1,064.00	10,108,000	
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,939.00	12,931,600	
テンポイノベーション	7,600	816.00	6,201,600	
フェイスネットワーク	3,600	1,289.00	4,640,400	
パーク２４	96,500	1,708.00	164,822,000	
パラカ	6,100	1,570.00	9,577,000	
三井不動産	812,400	2,323.50	1,887,611,400	
三菱地所	1,170,800	1,622.00	1,899,037,600	
平和不動産	30,900	3,880.00	119,892,000	
東京建物	176,700	1,652.00	291,908,400	
京阪神ビルディング	29,700	1,469.00	43,629,300	
住友不動産	374,000	3,406.00	1,273,844,000	
テーオーシー	35,400	688.00	24,355,200	
東京楽天地	3,500	3,865.00	13,527,500	
スターツコーポレーション	24,800	2,453.00	60,834,400	
フジ住宅	23,900	651.00	15,558,900	
空港施設	22,100	550.00	12,155,000	
明和地所	12,400	599.00	7,427,600	
ゴールドクレスト	15,300	1,599.00	24,464,700	
エスリード	8,300	1,688.00	14,010,400	
日神グループホールディングス	33,300	490.00	16,317,000	
日本エスコン	33,200	753.00	24,999,600	
タカラレーベン	74,600	296.00	22,081,600	
ＡＶＡＮＴＩＡ	12,000	831.00	9,972,000	
イオンモール	90,100	1,612.00	145,241,200	

毎日コムネット	9,200	700.00	6,440,000	
ファースト住建	8,600	1,138.00	9,786,800	
カチタス	44,400	3,660.00	162,504,000	
トーセイ	26,300	1,034.00	27,194,200	
穴吹興産	5,000	1,888.00	9,440,000	
サンフロンティア不動産	26,400	1,010.00	26,664,000	
ＦＪネクストホールディングス	19,600	974.00	19,090,400	
インテリックス	4,000	613.00	2,452,000	
ランドビジネス	7,500	259.00	1,942,500	
サンネクスタグループ	8,000	1,005.00	8,040,000	
グランディハウス	17,100	483.00	8,259,300	
日本空港ビルデング	68,200	4,800.00	327,360,000	
明豊ファシリティワークス	8,300	773.00	6,415,900	
日本工営	10,200	3,030.00	30,906,000	
ＬＩＦＵＬＬ	54,000	231.00	12,474,000	
ミクシィ	39,600	2,147.00	85,021,200	
ジェイエイシーリクルートメント	14,100	1,982.00	27,946,200	
日本M&Aセンターホールディングス	283,100	2,235.00	632,728,500	
メンバーズ	5,300	2,229.00	11,813,700	
中広	3,600	374.00	1,346,400	
ＵＴグループ	25,000	3,520.00	88,000,000	
アイティメディア	8,300	1,533.00	12,723,900	
Ｅ・Ｊホールディングス	9,300	1,137.00	10,574,100	
夢真ビーネックスグループ	46,100	1,488.00	68,596,800	
コシダカホールディングス	46,700	603.00	28,160,100	
アルトナー	4,500	867.00	3,901,500	
パソナグループ	18,800	2,686.00	50,496,800	
ＣＤＳ	4,500	1,568.00	7,056,000	
リンクアンドモチベーション	38,000	474.00	18,012,000	
エス・エム・エス	58,700	3,470.00	203,689,000	
サニーサイドアップグループ	6,400	714.00	4,569,600	
パーソルホールディングス	172,600	3,070.00	529,882,000	
リニカル	10,100	667.00	6,736,700	
クックパッド	55,400	260.00	14,404,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8,900	587.00	5,224,300	
学情	7,300	1,010.00	7,373,000	

スタジオアリス	7,900	2,106.00	16,637,400	
シミックホールディングス	9,800	1,422.00	13,935,600	
エプコ	4,100	729.00	2,988,900	
ＮＪＳ	4,000	1,945.00	7,780,000	
綜合警備保障	68,700	4,265.00	293,005,500	
カカクコム	126,700	2,582.00	327,139,400	
アイロムグループ	6,200	1,547.00	9,591,400	
セントケア・ホールディング	11,600	737.00	8,549,200	
サイネックス	3,400	589.00	2,002,600	
ルネサンス	12,300	1,033.00	12,705,900	
ディップ	30,400	3,380.00	102,752,000	
デジタルホールディングス	12,300	1,307.00	16,076,100	
新日本科学	21,200	1,235.00	26,182,000	
キャリアデザインセンター	4,700	960.00	4,512,000	
ベネフィット・ワン	62,800	3,785.00	237,698,000	
エムスリー	304,500	4,615.00	1,405,267,500	
ツカダ・グローバルホールディング	11,000	267.00	2,937,000	
アウトソーシング	99,000	1,346.00	133,254,000	
ウェルネット	18,100	429.00	7,764,900	
ワールドホールディングス	7,000	2,347.00	16,429,000	
ディー・エヌ・エー	65,900	1,796.00	118,356,400	
博報堂ＤＹホールディングス	240,400	1,908.00	458,683,200	
ぐるなび	29,100	386.00	11,232,600	
タカミヤ	21,600	397.00	8,575,200	
ジャパンベストレスキューシステム	11,700	853.00	9,980,100	
ファンコミュニケーションズ	43,900	378.00	16,594,200	
ライク	4,800	1,819.00	8,731,200	
ビジネス・ブレークスルー	7,100	397.00	2,818,700	
エスプール	49,000	1,131.00	55,419,000	
ＷＤＢホールディングス	8,000	2,790.00	22,320,000	
手間いらず	2,200	4,480.00	9,856,000	
ティア	10,800	431.00	4,654,800	
ＣＤＧ	2,100	1,359.00	2,853,900	
アドウェイズ	26,100	816.00	21,297,600	
バリューコマース	13,600	3,700.00	50,320,000	
インフォマート	189,400	773.00	146,406,200	

ＪＰホールディングス	45,600	229.00	10,442,400	
エコナックホールディングス	34,700	89.00	3,088,300	
ＣＬホールディングス	3,900	1,230.00	4,797,000	
プレステージ・インターナショナル	65,100	693.00	45,114,300	
アミューズ	9,500	2,003.00	19,028,500	
ドリームインキュベータ	5,000	1,900.00	9,500,000	
クイック	12,000	1,250.00	15,000,000	
ＴＡＣ	10,800	216.00	2,332,800	
電通グループ	177,900	4,245.00	755,185,500	
イオンファンタジー	6,800	1,863.00	12,668,400	
シーティーエス	19,800	752.00	14,889,600	
ネクシィーズグループ	6,500	674.00	4,381,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	45,200	2,905.00	131,306,000	
アルプス技研	15,400	1,811.00	27,889,400	
ダイオーズ	3,700	997.00	3,688,900	
日本空調サービス	18,400	775.00	14,260,000	
オリエンタルランド	203,900	18,735.00	3,820,066,500	
ダスキン	40,100	2,674.00	107,227,400	
明光ネットワークジャパン	20,800	559.00	11,627,200	
ファルコホールディングス	8,400	2,004.00	16,833,600	
ラウンドワン	48,400	1,357.00	65,678,800	
リゾートトラスト	79,200	1,870.00	148,104,000	
ビー・エム・エル	22,300	3,580.00	79,834,000	
りらいあコミュニケーションズ	26,400	993.00	26,215,200	
リソー教育	79,600	365.00	29,054,000	
早稲田アカデミー	9,900	1,025.00	10,147,500	
ユー・エス・エス	193,300	1,878.00	363,017,400	
東京個別指導学院	15,700	576.00	9,043,200	
サイバーエージェント	425,400	1,815.00	772,101,000	
楽天グループ	886,700	1,072.00	950,542,400	
クリーク・アンド・リバー社	9,200	1,812.00	16,670,400	
モーニングスター	30,700	616.00	18,911,200	
テー・オー・ダブリュー	31,200	290.00	9,048,000	
山田コンサルティンググループ	9,200	1,075.00	9,890,000	
セントラルスポーツ	6,600	2,370.00	15,642,000	
フルキャストホールディングス	14,800	2,099.00	31,065,200	

エン・ジャパン	28,000	2,912.00	81,536,000	
リソルホールディングス	1,900	4,265.00	8,103,500	
テクノプロ・ホールディングス	103,400	3,100.00	320,540,000	
アトラグループ	3,800	253.00	961,400	
インターワークス	5,800	374.00	2,169,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	8,000	5,340.00	42,720,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	11,200	1,853.00	20,753,600	
ファーストロジック	3,700	783.00	2,897,100	
三機サービス	3,600	962.00	3,463,200	
Ｇｕｎｏｓｙ	11,300	847.00	9,571,100	
デザインワン・ジャパン	5,900	188.00	1,109,200	
イー・ガーディアン	7,100	2,903.00	20,611,300	
リブセンス	11,300	177.00	2,000,100	
ジャパンマテリアル	53,200	1,770.00	94,164,000	
ベクトル	24,500	1,151.00	28,199,500	
ウチヤマホールディングス	9,500	304.00	2,888,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	13,100	1,257.00	16,466,700	
キャリアリンク	6,600	1,516.00	10,005,600	
ＩＢＪ	14,500	770.00	11,165,000	
アサンテ	7,800	1,670.00	13,026,000	
バリューＨＲ	7,000	2,393.00	16,751,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	14,300	4,800.00	68,640,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,900	1,482.00	10,225,800	
ＥＲＩホールディングス	5,100	1,161.00	5,921,100	
アビスト	2,800	2,874.00	8,047,200	
シグマクシス・ホールディングス	10,500	2,217.00	23,278,500	
ウィルグループ	12,900	1,247.00	16,086,300	
エスクロー・エージェント・ジャパン	24,900	175.00	4,357,500	
メドピア	13,400	2,966.00	39,744,400	
レアジョブ	3,600	760.00	2,736,000	
リクルートホールディングス	1,330,900	6,146.00	8,179,711,400	
エラン	24,100	981.00	23,642,100	
土木管理総合試験所	8,900	310.00	2,759,000	
ネットマーケティング	9,100	410.00	3,731,000	
日本郵政	2,253,100	966.10	2,176,719,910	
ベルシステム２４ホールディングス	25,000	1,449.00	36,225,000	

鎌倉新書	20,100	520.00	10,452,000	
ＳＭＮ	4,200	608.00	2,553,600	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,500	812.00	2,842,000	
エアトリ	11,300	2,634.00	29,764,200	
アトラエ	12,100	1,893.00	22,905,300	
ストライク	6,600	4,525.00	29,865,000	
ソラスト	42,600	1,071.00	45,624,600	
セラク	5,600	1,208.00	6,764,800	
インソース	16,800	2,039.00	34,255,200	
ベイカレント・コンサルティング	12,200	44,650.00	544,730,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,400	2,857.00	9,713,800	
アイモバイル	5,200	1,131.00	5,881,200	
キャリアインデックス	6,200	751.00	4,656,200	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	7,300	844.00	6,161,200	
船場	3,900	736.00	2,870,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	54,900	1,751.00	96,129,900	
フルテック	2,600	1,381.00	3,590,600	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	5,800	437.00	2,534,600	
ソウルドアウト	4,400	1,031.00	4,536,400	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	3,000	676.00	2,028,000	
ウェルビー	11,500	1,187.00	13,650,500	
エル・ティー・エス	2,300	2,437.00	5,605,100	
ミダックホールディングス	7,600	3,080.00	23,408,000	
日総工産	13,800	842.00	11,619,600	
キュービーネットホールディングス	8,100	1,700.00	13,770,000	
ＲＰＡホールディングス	25,100	336.00	8,433,600	
スプリックス	5,100	1,500.00	7,650,000	
マネジメントソリューションズ	8,500	3,430.00	29,155,000	
プロレド・パートナーズ	4,100	857.00	3,513,700	
テノ．ホールディングス	2,600	714.00	1,856,400	
フロンティア・マネジメント	4,900	658.00	3,224,200	
ピアラ	3,300	592.00	1,953,600	
コプロ・ホールディングス	3,600	1,137.00	4,093,200	
ギークス	3,100	1,464.00	4,538,400	
カーブスホールディングス	47,700	704.00	33,580,800	

フォーラムエンジニアリング	12,400	831.00	10,304,400	
ダイレクトマーケティングミックス	20,100	1,366.00	27,456,600	
ポピンズホールディングス	4,100	2,553.00	10,467,300	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	14,000	3,255.00	45,570,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	9,200	740.00	6,808,000	
リログループ	94,500	2,036.00	192,402,000	
東祥	13,100	1,420.00	18,602,000	
ＴＲＥホールディングス	23,800	1,531.00	36,437,800	
人・夢・技術グループ	7,000	1,877.00	13,139,000	
エイチ・アイ・エス	38,500	1,924.00	74,074,000	
ラックランド	5,100	2,703.00	13,785,300	
共立メンテナンス	30,900	4,005.00	123,754,500	
イチネンホールディングス	17,900	1,268.00	22,697,200	
建設技術研究所	10,400	2,409.00	25,053,600	
スペース	12,700	887.00	11,264,900	
燦ホールディングス	7,700	1,507.00	11,603,900	
スバル興業	1,100	8,660.00	9,526,000	
東京テアトル	6,700	1,205.00	8,073,500	
タナベ経営	7,100	639.00	4,536,900	
ナガワ	5,500	10,200.00	56,100,000	
東京都競馬	13,000	4,085.00	53,105,000	
カナモト	30,500	2,282.00	69,601,000	
西尾レントオール	16,000	2,768.00	44,288,000	
トランス・コスモス	22,000	3,100.00	68,200,000	
乃村工藝社	74,300	961.00	71,402,300	
藤田観光	7,500	2,224.00	16,680,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	10,700	1,344.00	14,380,800	
日本管財	18,600	2,810.00	52,266,000	
トーカイ	15,300	1,901.00	29,085,300	
セコム	170,000	7,718.00	1,312,060,000	
セントラル警備保障	8,400	2,234.00	18,765,600	
丹青社	35,700	740.00	26,418,000	
メイテック	20,900	6,560.00	137,104,000	
応用地質	19,600	2,055.00	40,278,000	
船井総研ホールディングス	35,400	2,450.00	86,730,000	
進学会ホールディングス	6,800	300.00	2,040,000	

オオバ	12,500	728.00	9,100,000	
いであ	4,800	1,721.00	8,260,800	
学究社	5,700	1,523.00	8,681,100	
ベネッセホールディングス	57,600	2,265.00	130,464,000	
イオンディライト	21,300	3,065.00	65,284,500	
ナック	8,500	945.00	8,032,500	
ダイセキ	31,700	4,675.00	148,197,500	
ステップ	6,500	1,840.00	11,960,000	
合　計	195,880,500		478,384,690,050	

(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。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月 20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	192,267,526
コール・ローン	5,760,175,683
国債証券	296,954,980,057
派生商品評価勘定	446,323
未収利息	1,736,253,585
前払金	102,462,940
前払費用	82,341,517
差入委託証拠金	380,319,082
流動資産合計	305,209,246,713
資産合計	305,209,246,713
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	155,073,816
未払解約金	56,545,310
未払利息	8,637
流動負債合計	211,627,763

負債合計	211,627,763
純資産の部	
元本等	
元本	99,838,150,047
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	205,159,468,903
元本等合計	304,997,618,950
純資産合計	304,997,618,950
負債純資産合計	305,209,246,713

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月 20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 1月 20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	99,838,150,047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 3.0549円 (1万口当たり純資産額) (30,549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 1月 20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月 20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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 1月 20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月 21日
期首元本額	94,925,048,586円
期中追加設定元本額	18,464,979,910円
期中一部解約元本額	13,551,878,449円
期末元本額	99,838,150,047円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,353,264,978円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	583,951,881円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,132,380,782円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	9,598,073円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	8,075,275,758円
世界経済インデックスファンド	12,400,849,452円
ＤＣマイセレクション２５	1,914,914,780円
ＤＣマイセレクション５０	1,636,612,404円
ＤＣマイセレクション７５	1,139,329,552円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,263,400,969円
ＤＣマイセレクションＳ２５	907,524,757円
ＤＣマイセレクションＳ５０	719,713,675円
ＤＣマイセレクションＳ７５	393,832,613円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	33,892,851円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	88,370,664円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	44,880,089円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	12,155,146,927円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	647,490,776円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,905,905円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,288,528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）	24,592,578円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	51,768,994円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	80,695,705円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	77,774,842円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	85,922,076円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,396,835,506円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	457,581,750円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,819,540,276円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	121,017,203円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	58,059,740円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	473,071,649円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	171,577,863円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	221,234,597円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	757,627,819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）	2,053,507,055円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	722,945,345円
外国債券ファンド・シリーズ１	668,070,931円
コア投資戦略ファンド（安定型）	681,973,907円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,818,091,465円
分散投資コア戦略ファンドＡ	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドＳ	556,972,964円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	511,465,046円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,873,065,760円
コア投資戦略ファンド（切替型）	775,215,048円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	245,900,131円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	106,355,945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）	1,379,145,123 円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	196,130,892 円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	18,833,306,990 円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	223,789,556 円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	268,877,633 円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	446,074,324 円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	4,182,998 円
グローバル経済コア	834,754,898 円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	14,729,148 円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,419,108 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	230,570,686 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,206,999 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	6,802,858 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	5,780,467 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	3,369,648 円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	3,997,019 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）	374,194,107 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）	10,881,146,851 円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	334,300,420 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）	334,038,008 円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	316,825,189 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	59,323,945 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）	82,461,826 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022 年 1 月 20 日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△6,841,377,416
合計	△6,841,377,416

(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 1 月 20 日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち 1 年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	5,719,800,575	－	5,617,337,635	△102,462,940
合計		5,719,800,575	－	5,617,337,635	△102,462,940

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2022年 1月 20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	5,795,734,941	―	5,743,570,388	△52,164,553
	アメリカドル	2,852,889,903	―	2,829,535,660	△23,354,243
	カナダドル	221,045,074	―	220,270,385	△774,689
	ユーロ	2,355,595,919	―	2,331,055,340	△24,540,579
	イギリスポンド	366,204,045	―	362,709,003	△3,495,042
合計		5,795,734,941	―	5,743,570,388	△52,164,553

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,819,140.60	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,619,847.67	
		T 0.125% 03/31/23	8,000,000.00	7,944,531.28	
		T 0.125% 04/30/23	5,000,000.00	4,959,667.95	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,436,572.27	
		T 0.125% 05/31/23	6,800,000.00	6,737,312.50	
		T 0.125% 07/31/23	5,000,000.00	4,942,871.10	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	7,954,369.91	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,885,000.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,195,727.53	
		T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,373,374.97	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,765,898.47	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,091,518.54	

		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,795,312.50	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	7,937,500.00	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,803,125.00	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	960,742.19	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,592,578.10	
		T 0.25% 09/30/23	12,000,000.00	11,861,015.64	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,173,632.85	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,437,015.61	
		T 0.25% 11/15/23	11,000,000.00	10,855,625.00	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,638,437.52	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,884,609.41	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,741,562.48	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,830,503.95	
		T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	8,853,925.80	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,893,554.70	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,426,250.00	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,872,968.75	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,826,406.24	
		T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	11,020,234.37	
		T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,756,493.56	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,026,526.59	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,769,457.03	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,290,683.58	
		T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,668,453.12	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,362,560.96	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,999,316.42	
		T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	12,822,187.50	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,659,375.04	
		T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	14,458,425.86	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,347,070.32	
		T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,376,562.50	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,019,218.75	
		T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	10,639,921.93	
		T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,898,281.25	
		T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	11,380,829.68	
		T 0.75% 11/15/24	5,860,000.00	5,772,328.89	

		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,754,375.04	
		T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,799,375.00	
		T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,302,425.83	
		T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	14,186,976.56	
		T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,720,000.00	
		T 1.125% 05/15/40	6,260,000.00	5,236,392.21	
		T 1.125% 08/15/40	7,300,000.00	6,082,953.12	
		T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	9,791,230.51	
		T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,998,115.22	
		T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,759,375.04	
		T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	6,957,843.75	
		T 1.25% 06/30/28	9,500,000.00	9,199,414.11	
		T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,576,215.82	
		T 1.25% 08/15/31	12,680,000.00	12,032,131.24	
		T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	14,010,625.00	
		T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	4,004,843.76	
		T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,038,964.85	
		T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,213,132.86	
		T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,518,457.02	
		T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,029,140.64	
		T 1.375% 11/15/31	4,030,000.00	3,860,928.92	
		T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	5,215,781.28	
		T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,255,582.00	
		T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,962,500.00	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,328,468.75	
		T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,874,953.16	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,038,203.12	
		T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,466,308.57	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,555,449.24	
		T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,129,425.76	
		T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,538,281.25	
		T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,274,876.95	
		T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	10,962,714.89	
		T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,011,230.47	
		T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,675,644.56	
		T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,528,759.77	

		T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,802,843.76	
		T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	6,090,328.12	
		T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,783,921.08	
		T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,639,361.34	
		T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,737,061.92	
		T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,432,718.74	
		T 1.75% 08/15/41	14,500,000.00	13,403,437.50	
		T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,993,671.89	
		T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	7,468,585.97	
		T 1.875% 02/15/51	13,600,000.00	12,743,624.99	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,255,888.65	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,100,312.50	
		T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,664,218.75	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,211,363.29	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,561,585.95	
		T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,457,375.00	
		T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,683,531.26	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,911,562.51	
		T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	5,115,820.30	
		T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,735,275.00	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,096,250.00	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,218,150.41	
		T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,711,523.47	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,175,273.42	
		T 2.25% 05/15/41	4,600,000.00	4,619,406.25	
		T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	8,807,168.01	
		T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	4,213,896.11	
		T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	5,590,664.09	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,468,082.04	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,421,591.77	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,523,406.27	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,878,005.87	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,605,556.63	
		T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,545,757.82	
		T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,091,308.60	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,915,475.01	

		T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,687,140.63	
		T 2.375% 05/15/27	5,840,000.00	6,053,525.00	
		T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,331,651.56	
		T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	2,881,269.54	
		T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,147,070.30	
		T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	6,372,593.75	
		T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,570,711.33	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,174,023.45	
		T 2.5% 02/15/45	5,210,000.00	5,461,545.31	
		T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,208,437.52	
		T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,136,932.60	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,143,789.10	
		T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,314,335.93	
		T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,663,927.72	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,891,889.86	
		T 2.625% 02/15/29	7,490,000.00	7,907,216.44	
		T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,430,734.38	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,535,468.75	
		T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,026,423.82	
		T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,606,708.98	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,071,669.54	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,103,828.14	
		T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,936,347.68	
		T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,690,984.38	
		T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	3,983,062.50	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,745,781.25	
		T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,028,535.16	
		T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,415,070.31	
		T 2.75% 08/15/47	7,050,000.00	7,811,179.68	
		T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,543,974.61	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,214,273.47	
		T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,393,542.19	
		T 2.75% 11/15/42	3,920,000.00	4,266,675.00	
		T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,380,972.67	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,190,937.52	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,747,497.67	

		T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,608,445.31	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,382,436.74	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,003,837.50	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,731,293.75	
		T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	4,189,806.26	
		T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	2,576,000.00	
		T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	4,904,003.93	
		T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,583,642.57	
		T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,158,501.58	
		T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	7,889,062.50	
		T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,074,121.10	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,626,556.25	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	4,823,046.90	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,351,436.34	
		T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,374,777.72	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,609,140.62	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,021,340.62	
		T 2% 08/15/51	15,150,000.00	14,622,117.17	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,402,442.94	
		T 2% 11/15/41	2,900,000.00	2,797,593.75	
		T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,209,304.68	
		T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	2,304,062.50	
		T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,059,942.99	
		T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	4,803,046.87	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,125,812.50	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,011,132.81	
		T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,623,757.81	
		T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	6,608,437.50	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	926,466.41	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,988,750.00	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,482,968.76	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,499,218.76	
		T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,796,640.64	
		T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,830,625.00	
		T 3% 02/15/47	800,000.00	922,750.00	
		T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,173,820.31	

		T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,192,734.41	
		T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,833,257.82	
		T 3% 05/15/45	3,500,000.00	3,993,281.25	
		T 3% 05/15/47	3,210,000.00	3,710,057.81	
		T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,350,101.56	
		T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,432,148.44	
		T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,278,906.25	
		T 3% 11/15/44	2,800,000.00	3,186,750.00	
		T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,184,203.12	
		T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,111,179.68	
		T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,322,812.50	
		T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,550,601.57	
		T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,629,757.81	
		T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,684,462.50	
		T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,443,142.97	
		T 4.5% 05/15/38	550,000.00	738,375.00	
		T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,303,632.82	
		T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,900,950.00	
		T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,055,976.56	
		T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,540,171.87	
		T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,591,687.50	
		T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,539,265.62	
		T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,001,285.15	
		T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,806,835.93	
		T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,412,988.28	
		T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,788,541.98	
	アメリカドル 小計		1,224,640,000.00	1,231,692,803.67 (140,794,804,387)	
	カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,034,143.00	
		CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,154,828.00	
		CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,342,592.00	
		CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,570,828.00	
		CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,340,348.00	
		CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,385,735.20	
		CAN 0.5% 12/01/30	4,420,000.00	3,941,800.20	
		CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,428,379.20	

		CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,469,770.00	
		CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,074,836.40	
		CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,352,846.40	
		CAN 1.5% 06/01/31	3,260,000.00	3,158,711.80	
		CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,202,508.00	
		CAN 1.5% 12/01/31	1,240,000.00	1,194,293.60	
		CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,646,027.80	
		CAN 1.75% 12/01/53	1,680,000.00	1,538,208.00	
		CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,669,865.20	
		CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,483,656.30	
		CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,343,838.00	
		CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,842,102.00	
		CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,304,175.60	
		CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,364,473.60	
		CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,141,564.40	
		CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	887,908.00	
		CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,331,968.70	
		CAN 2% 09/01/23	3,460,000.00	3,503,146.20	
		CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	4,625,643.90	
		CAN 3.5% 12/01/45	1,300,000.00	1,647,269.00	
		CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,370,607.00	
		CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,492,276.50	
		CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,326,220.80	
		CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,139,070.20	
	カナダドル 小計		64,460,000.00	65,309,641.00 (5,971,260,476)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,183,648.50	
		MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	32,529,592.00	
		MBONO 5.5% 03/04/27	3,000,000.00	2,732,100.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	47,710,000.00	44,655,605.80	
		MBONO 6.75% 03/09/23	22,180,000.00	22,160,481.60	
		MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	38,709,224.40	
		MBONO 7.75% 05/29/31	31,580,000.00	31,659,581.60	
		MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	23,517,276.10	
		MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	10,587,068.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	38,660,000.00	40,489,004.60	

		MBONO 8.5% 11/18/38	28,220,000.00	29,528,843.60	
		MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	34,895,704.50	
		MBONO 8% 11/07/47	27,200,000.00	27,038,704.00	
		MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	35,279,722.50	
	メキシコペソ 小計		380,700,000.00	383,966,557.20 (2,140,767,143)	
	ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,364,876.20	
		BGB 0.2% 10/22/23	1,030,000.00	1,044,687.80	
		BGB 0.4% 06/22/40	1,140,000.00	1,069,388.40	
		BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,665,716.40	
		BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	516,716.80	
		BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,790,201.60	
		BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,780,347.40	
		BGB 0.8% 06/22/28	2,160,000.00	2,283,487.20	
		BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,512,810.00	
		BGB 0% 10/22/27	430,000.00	433,556.10	
		BGB 0% 10/22/31	1,020,000.00	990,766.80	
		BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,658,040.00	
		BGB 1.45% 06/22/37	1,050,000.00	1,178,709.00	
		BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,589,042.40	
		BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,531,660.00	
		BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,256,881.50	
		BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,408,797.20	
		BGB 1% 06/22/31	2,770,000.00	2,966,032.90	
		BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	1,203,611.20	
		BGB 2.25% 06/22/23	1,180,000.00	1,228,911.00	
		BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,044,720.60	
		BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,304,566.00	
		BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	1,939,932.00	
		BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,349,742.90	
		BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	3,041,985.10	
		BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,374,178.80	
		BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,489,698.00	
		BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,764,147.80	
		BGB 5% 03/28/35	2,220,000.00	3,515,925.00	
		BKO 0% 03/10/23	1,210,000.00	1,219,099.20	

		BKO 0% 06/16/23	1,090,000.00	1,099,679.20	
		BKO 0% 09/15/23	3,150,000.00	3,182,004.00	
		BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,039,541.00	
		BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,625,080.80	
		BTPS 0.3% 08/15/23	2,900,000.00	2,926,245.00	
		BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	583,329.20	
		BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,726,398.20	
		BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,230,182.00	
		BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,125,118.20	
		BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,965,122.80	
		BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	680,103.60	
		BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,280,735.00	
		BTPS 0.9% 04/01/31	3,800,000.00	3,684,556.00	
		BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,029,420.00	
		BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	920,244.00	
		BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,619,809.40	
		BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,193,205.00	
		BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,414,057.80	
		BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	2,064,479.40	
		BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,001,990.00	
		BTPS 0% 04/15/24	3,000,000.00	3,000,540.00	
		BTPS 0% 08/01/26	2,580,000.00	2,520,866.40	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,018,796.00	
		BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	1,979,692.40	
		BTPS 1.45% 03/01/36	1,700,000.00	1,665,915.00	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,393,656.00	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,490,168.00	
		BTPS 1.5% 04/30/45	1,850,000.00	1,692,306.00	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,513,316.70	
		BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,971,301.90	
		BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,103,490.60	
		BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,634,386.40	
		BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,529,085.60	
		BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,333,088.00	
		BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,783,700.70	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,556,673.00	

		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,848,041.00	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,945,938.40	
		BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,433,216.00	
		BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	663,650.30	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,469,855.60	
		BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	1,984,440.00	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,920,816.80	
		BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,936,681.90	
		BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	3,042,608.70	
		BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,195,971.00	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,150,688.50	
		BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	2,502,449.30	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	1,221,010.20	
		BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,133,583.20	
		BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,408,258.00	
		BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,427,240.00	
		BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,224,972.20	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,701,486.60	
		BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,415,055.50	
		BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,683,269.60	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,718,136.80	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,720,438.80	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,357,303.00	
		BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	2,544,814.80	
		BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	3,855,734.40	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,015,512.50	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,430,854.40	
		BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,804,394.40	
		BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	3,932,254.50	
		BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,544,215.50	
		BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	3,177,993.00	
		BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,644,252.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	4,457,550.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,709,595.20	
		BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	3,302,101.20	
		BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,208,048.40	

		BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,154,079.60	
		BTPS 5% 09/01/40	2,880,000.00	4,339,382.40	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,783,248.00	
		BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	4,190,264.40	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,848,308.00	
		BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	930,848.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,005,922.00	
		DBR 0.25% 02/15/29	3,080,000.00	3,183,857.60	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,717,026.70	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	3,177,605.20	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,111,540.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	2,710,000.00	2,838,806.30	
		DBR 0.5% 08/15/27	4,040,000.00	4,222,406.00	
		DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,615,696.00	
		DBR 0% 02/15/31	3,120,000.00	3,145,053.60	
		DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,784,552.60	
		DBR 0% 05/15/36	2,650,000.00	2,599,888.50	
		DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,425,081.00	
		DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,550,925.00	
		DBR 0% 08/15/30	4,190,000.00	4,236,509.00	
		DBR 0% 08/15/30	670,000.00	680,659.70	
		DBR 0% 08/15/31	3,450,000.00	3,466,663.50	
		DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	4,103,307.00	
		DBR 0% 08/15/52	920,000.00	841,864.40	
		DBR 0% 11/15/27	2,960,000.00	3,009,787.20	
		DBR 0% 11/15/28	2,500,000.00	2,538,775.00	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,526,444.60	
		DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,029,796.80	
		DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,105,828.40	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,401,981.00	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,732,071.00	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,081,340.00	
		DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,862,337.60	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,414,642.40	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,810,000.00	5,961,583.20	
		DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	2,980,720.60	

		DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	3,661,057.90	
		DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,685,187.20	
		DBR 4.25% 07/04/39	2,310,000.00	4,004,523.60	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,393,718.50	
		DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	4,799,936.70	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,680,000.00	4,998,200.00	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,305,070.80	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,210,119.20	
		DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,670,249.00	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,904,525.00	
		DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,351,077.00	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,781,041.20	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,751,774.60	
		FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,254,763.30	
		FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,523,126.00	
		FRTR 0.5% 05/25/40	2,760,000.00	2,649,572.40	
		FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	752,746.50	
		FRTR 0.5% 06/25/44	1,530,000.00	1,438,200.00	
		FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,609,532.00	
		FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	3,574,432.00	
		FRTR 0.75% 05/25/53	1,240,000.00	1,153,485.20	
		FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	6,148,467.00	
		FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,064,616.50	
		FRTR 0% 02/25/24	4,850,000.00	4,903,592.50	
		FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,266,163.80	
		FRTR 0% 02/25/27	2,560,000.00	2,577,433.60	
		FRTR 0% 03/25/23	5,060,000.00	5,098,557.20	
		FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,019,496.00	
		FRTR 0% 03/25/25	6,390,000.00	6,465,849.30	
		FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,210,661.20	
		FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	5,920,226.80	
		FRTR 0% 11/25/31	5,830,000.00	5,645,189.00	
		FRTR 1.25% 05/25/34	5,090,000.00	5,553,393.60	
		FRTR 1.25% 05/25/36	5,130,000.00	5,604,678.90	
		FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,568,586.90	
		FRTR 1.5% 05/25/50	3,890,000.00	4,441,991.00	

		FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,553,451.20	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,780,000.00	2,199,332.40	
		FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,543,469.80	
		FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,421,248.00	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,936,347.00	
		FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,545,742.40	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,368,222.00	
		FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,636,604.80	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	6,970,213.80	
		FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,506,639.60	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,086,372.00	
		FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,375,144.00	
		FRTR 4.25% 10/25/23	5,650,000.00	6,137,086.50	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	7,621,714.40	
		FRTR 4.75% 04/25/35	3,130,000.00	4,854,285.70	
		FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	4,497,061.80	
		FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	3,950,420.60	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,204,358.40	
		FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,235,776.90	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	6,842,183.60	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,359,363.00	
		FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,116,010.00	
		IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	946,098.30	
		IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,025,169.30	
		IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	595,457.60	
		IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	481,350.00	
		IRISH 0.9% 05/15/28	810,000.00	857,741.40	
		IRISH 0% 10/18/31	1,300,000.00	1,253,811.00	
		IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,288,572.00	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	731,479.20	
		IRISH 1.35% 03/18/31	620,000.00	682,310.00	
		IRISH 1.5% 05/15/50	870,000.00	989,390.10	
		IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	946,731.00	
		IRISH 1% 05/15/26	1,640,000.00	1,727,887.60	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,435,652.90	
		IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,447,758.00	

		IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,052,847.70	
		IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,062,823.00	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,372,419.20	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,361,928.80	
		NETHER 0.25% 07/15/29	2,070,000.00	2,117,361.60	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,440,000.00	1,493,755.20	
		NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,407,116.00	
		NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,225,037.20	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,716,843.60	
		NETHER 0% 01/15/24	1,830,000.00	1,851,594.00	
		NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,862,319.20	
		NETHER 0% 01/15/29	600,000.00	602,400.00	
		NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	910,387.20	
		NETHER 0% 01/15/52	1,230,000.00	1,087,652.10	
		NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,916,966.40	
		NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,357,300.10	
		NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,009,995.20	
		NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,536,594.80	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,430,000.00	3,855,000.60	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,115,927.20	
		NETHER 3.75% 01/15/23	1,560,000.00	1,628,406.00	
		NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	3,758,085.00	
		NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,387,916.20	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,324,687.50	
		NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	216,160.00	
		OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,374,355.60	
		OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	3,121,207.60	
		OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,809,587.50	
		OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,238,315.00	
		OBL 0% 10/09/26	2,900,000.00	2,947,676.00	
		OBL 0% 10/10/25	3,500,000.00	3,557,820.00	
		OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,527,229.10	
		OBL 0% 10/18/24	4,190,000.00	4,253,646.10	
		RAGB 0.25% 10/20/36	730,000.00	701,325.60	
		RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,829,118.00	
		RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	921,577.20	

		RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,701,550.80	
		RAGB 0.75% 03/20/51	680,000.00	682,624.80	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,177,302.40	
		RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	274,259.70	
		RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,434,804.00	
		RAGB 0% 02/20/31	1,200,000.00	1,176,492.00	
		RAGB 0% 04/20/23	1,140,000.00	1,149,416.40	
		RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	942,071.40	
		RAGB 0% 07/15/23	1,120,000.00	1,130,438.40	
		RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,459,008.00	
		RAGB 0% 10/20/40	510,000.00	454,971.00	
		RAGB 1.2% 10/20/25	700,000.00	741,951.00	
		RAGB 1.5% 02/20/47	1,030,000.00	1,232,158.10	
		RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	402,699.00	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,049,716.80	
		RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,385,607.30	
		RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	1,191,979.80	
		RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,350,496.80	
		RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,283,429.00	
		RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	943,825.80	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,822,619.80	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,669,975.20	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,601,590.40	
		RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	514,884.60	
		RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	399,339.80	
		RFGB 0.125% 09/15/31	400,000.00	396,456.00	
		RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	476,265.00	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	641,886.00	
		RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	902,842.50	
		RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	673,666.50	
		RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	787,793.20	
		RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	843,784.00	
		RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	722,043.60	
		RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	545,869.80	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	425,871.60	
		RFGB 0% 09/15/26	590,000.00	596,478.20	

		RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	623,196.00	
		RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	612,858.40	
		RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	589,612.10	
		RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	667,225.00	
		RFGB 2.625% 07/04/42	640,000.00	908,384.00	
		RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	498,061.20	
		RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	773,011.60	
		RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	958,791.10	
		SPGB 0.1% 04/30/31	3,180,000.00	3,033,592.80	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,325,266.00	
		SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,638,321.40	
		SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,910,179.00	
		SPGB 0.5% 10/31/31	1,710,000.00	1,680,622.20	
		SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	2,999,206.00	
		SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,527,400.80	
		SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	924,230.40	
		SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,299,288.80	
		SPGB 0% 01/31/26	2,220,000.00	2,225,305.80	
		SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,903,346.70	
		SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,396,588.60	
		SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,127,091.00	
		SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	2,249,265.00	
		SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,237,300.50	
		SPGB 1.3% 10/31/26	2,750,000.00	2,923,195.00	
		SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,673,587.70	
		SPGB 1.4% 07/30/28	1,470,000.00	1,581,014.40	
		SPGB 1.45% 04/30/29	4,490,000.00	4,851,759.30	
		SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,264,169.60	
		SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	567,864.00	
		SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,849,704.00	
		SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,235,623.00	
		SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,061,162.50	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,052,446.80	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,299,415.00	
		SPGB 1% 07/30/42	650,000.00	623,792.00	
		SPGB 1% 10/31/50	2,470,000.00	2,204,647.90	

		SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,056,858.50	
		SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,855,044.00	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,392,938.00	
		SPGB 2.75% 10/31/24	3,050,000.00	3,317,454.50	
		SPGB 2.9% 10/31/46	2,200,000.00	2,926,550.00	
		SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	2,653,552.80	
		SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,764,314.00	
		SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,672,902.20	
		SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,925,401.90	
		SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,333,421.60	
		SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,273,579.20	
		SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,659,560.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,684,487.50	
		SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,701,581.60	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,910,000.00	3,390,250.00	
		SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,229,507.00	
		SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	4,337,247.20	
		SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,419,217.20	
		SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,471,533.00	
	ユーロ 小計		782,910,000.00	887,820,926.30 (115,203,643,396)	
	イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,468,852.00	
		UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,480,234.00	
		UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,923,935.30	
		UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,133,711.20	
		UKT 0.25% 01/31/25	620,000.00	606,688.60	
		UKT 0.25% 07/31/31	3,270,000.00	2,975,536.50	
		UKT 0.375% 10/22/26	1,910,000.00	1,849,987.80	
		UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,254,012.20	
		UKT 0.5% 01/31/29	350,000.00	334,309.50	
		UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,035,659.20	
		UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,683,000.00	
		UKT 0.625% 07/31/35	2,360,000.00	2,131,740.80	
		UKT 0.625% 10/22/50	1,590,000.00	1,309,253.70	
		UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,359,126.80	
		UKT 0.875% 01/31/46	1,170,000.00	1,035,929.70	

		UKT 0.875% 07/31/33	200,000.00	190,826.00	
		UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,665,031.00	
		UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	475,730.00	
		UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	960,868.00	
		UKT 1.25% 07/31/51	550,000.00	530,112.00	
		UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,702,140.00	
		UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,637,216.00	
		UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	2,409,768.60	
		UKT 1.5% 07/31/53	200,000.00	208,102.00	
		UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,676,813.40	
		UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	1,992,766.80	
		UKT 1.625% 10/22/71	1,320,000.00	1,567,420.80	
		UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,401,920.00	
		UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	2,487,576.00	
		UKT 1.75% 09/07/37	2,630,000.00	2,749,559.80	
		UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,604,256.00	
		UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,557,100.00	
		UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	2,757,676.80	
		UKT 2.75% 09/07/24	1,470,000.00	1,539,413.40	
		UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,846,127.00	
		UKT 3.25% 01/22/44	2,580,000.00	3,455,265.00	
		UKT 3.5% 01/22/45	2,290,000.00	3,210,992.20	
		UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,506,153.80	
		UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,540,160.00	
		UKT 4.25% 03/07/36	2,090,000.00	2,863,132.80	
		UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,704,947.00	
		UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,338,696.80	
		UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,617,490.50	
		UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	2,565,097.50	
		UKT 4.25% 12/07/46	1,920,000.00	3,048,345.60	
		UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,501,813.30	
		UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	3,420,370.70	
		UKT 4.5% 09/07/34	2,110,000.00	2,881,458.20	
		UKT 4.5% 12/07/42	2,210,000.00	3,433,257.10	
		UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,897,445.20	
		UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,484,372.00	

		UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,810,176.60	
		UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,022,768.00	
		UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,654,912.50	
	イギリスポンド 小計		96,120,000.00	112,499,255.70 (17,520,634,082)	
	スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	6,321,190.00	
		SGB 0.75% 05/12/28	7,380,000.00	7,590,772.80	
		SGB 0.75% 11/12/29	8,060,000.00	8,326,463.60	
		SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	12,873,000.00	
		SGB 1% 11/12/26	10,030,000.00	10,405,021.70	
		SGB 2.25% 06/01/32	4,680,000.00	5,549,731.20	
		SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	10,043,907.00	
		SGB 3.5% 03/30/39	5,310,000.00	7,796,460.60	
	スウェーデンクローナ 小計		63,730,000.00	68,906,546.90 (865,466,229)	
	ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,240,000.00	3,051,885.60	
		NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	6,209,654.40	
		NGB 1.5% 02/19/26	6,360,000.00	6,296,972.40	
		NGB 1.75% 02/17/27	6,060,000.00	6,043,638.00	
		NGB 1.75% 03/13/25	5,720,000.00	5,732,641.20	
		NGB 1.75% 09/06/29	6,540,000.00	6,476,954.40	
		NGB 2% 04/26/28	4,510,000.00	4,550,499.80	
		NGB 2% 05/24/23	10,660,000.00	10,771,290.40	
		NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,587,424.00	
	ノルウェークローネ 小計		56,930,000.00	56,720,960.20 (739,074,111)	
	デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,870,000.00	5,648,759.70	
		DGB 0.5% 11/15/27	8,850,000.00	9,169,750.50	
		DGB 0.5% 11/15/29	12,410,000.00	12,887,660.90	
		DGB 0% 11/15/24	2,130,000.00	2,155,858.20	
		DGB 0% 11/15/31	5,830,000.00	5,735,787.20	
		DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,700,847.00	
		DGB 1.75% 11/15/25	7,280,000.00	7,850,606.40	
		DGB 4.5% 11/15/39	13,980,000.00	24,548,320.80	
	デンマーククローネ 小計		63,770,000.00	75,697,590.70 (1,319,409,005)	

	ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,570,000.00	2,172,498.10	
		POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,273,064.00	
		POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,186,076.70	
		POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,332,740.50	
		POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,831,514.20	
		POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	5,837,263.20	
		POLGB 2.5% 04/25/24	2,890,000.00	2,851,100.60	
		POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	5,749,303.80	
		POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	3,514,606.20	
		POLGB 2.75% 04/25/28	5,380,000.00	5,032,236.80	
		POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	5,715,247.00	
		POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	4,866,792.00	
		POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	3,825,123.20	
		POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	669,276.00	
	ポーランドズロチ 小計		54,900,000.00	51,856,842.30 (1,487,217,937)	
	オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,858,888.90	
		ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,234,793.60	
		ACGB 0.5% 09/21/26	2,040,000.00	1,940,896.80	
		ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,554,447.20	
		ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,069,194.70	
		ACGB 1.75% 06/21/51	1,760,000.00	1,459,550.40	
		ACGB 1.75% 11/21/32	2,010,000.00	1,960,674.60	
		ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	2,973,295.00	
		ACGB 1% 12/21/30	3,310,000.00	3,057,778.00	
		ACGB 2.25% 05/21/28	2,230,000.00	2,298,371.80	
		ACGB 2.5% 05/21/30	3,470,000.00	3,632,881.80	
		ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,437,794.40	
		ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,696,944.10	
		ACGB 2.75% 06/21/35	1,050,000.00	1,124,487.00	
		ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	2,043,754.20	
		ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,763,285.20	
		ACGB 2.75% 11/21/29	1,410,000.00	1,501,734.60	
		ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,716,134.40	
		ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,414,170.00	
		ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,102,039.40	

		ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	1,931,169.60	
		ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,811,812.80	
		ACGB 4.25% 04/21/26	1,890,000.00	2,102,530.50	
		ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,891,773.50	
		ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,684,100.80	
		ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,652,000.00	
	オーストラリアドル 小計		56,390,000.00	57,914,503.30 (4,788,371,132)	
	シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	723,967.50	
		SIGB 1.625% 07/01/31	300,000.00	294,126.00	
		SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	809,152.00	
		SIGB 1.875% 03/01/50	810,000.00	755,827.20	
		SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	300,563.20	
		SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,106,406.00	
		SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	909,313.00	
		SIGB 2.375% 06/01/25	730,000.00	754,710.50	
		SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	447,470.90	
		SIGB 2.625% 05/01/28	530,000.00	558,360.30	
		SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	837,482.00	
		SIGB 2.75% 04/01/42	750,000.00	825,990.00	
		SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,100,141.90	
		SIGB 2.875% 07/01/29	950,000.00	1,019,274.00	
		SIGB 2.875% 09/01/30	1,020,000.00	1,101,732.60	
		SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	418,351.70	
		SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	949,461.90	
		SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	957,756.80	
		SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,662,297.30	
	シンガポールドル 小計		14,900,000.00	15,532,384.80 (1,318,388,821)	
	マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	790,000.00	725,133.10	
		MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,948,396.80	
		MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,366,464.50	
		MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,521,808.20	
		MGS 3.733% 06/15/28	2,630,000.00	2,667,346.00	
		MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,111,603.80	
		MGS 3.757% 05/22/40	1,520,000.00	1,422,340.00	

		MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	951,194.70	
		MGS 3.828% 07/05/34	660,000.00	645,354.60	
		MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,656,205.80	
		MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,058,129.30	
		MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,527,630.00	
		MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,159,628.60	
		MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,024,963.00	
		MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,480,176.00	
		MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	616,626.00	
		MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,215,784.00	
		MGS 4.059% 09/30/24	1,780,000.00	1,832,866.00	
		MGS 4.065% 06/15/50	1,560,000.00	1,496,196.00	
		MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,319,232.00	
		MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	3,122,430.00	
		MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,080,222.20	
		MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,043,539.90	
		MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	3,024,793.20	
		MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,007,837.20	
		MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,549,604.40	
		MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,463,448.80	
		MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,499,951.30	
		MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,797,784.80	
		MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,111,854.10	
	マレーシアリンギット 小計		52,870,000.00	54,448,544.30 (1,486,227,465)	
	イスラエルシェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	699,779.43	
		ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	850,931.12	
		ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,411,820.14	
		ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,039,839.58	
		ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,792,007.17	
		ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,129,131.14	
		ILGOV 1% 03/31/30	2,650,000.00	2,593,337.16	
		ILGOV 2.25% 09/28/28	2,360,000.00	2,544,660.32	
		ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,909,735.40	
		ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,379,438.54	
		ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	3,880,704.83	

		ILGOV 4.25% 03/31/23	3,430,000.00	3,598,929.90	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	2,410,000.00	3,717,563.57	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	3,060,000.00	3,838,709.10	
	イスラエルシェケル 小計		32,870,000.00	36,386,587.40 (1,328,219,599)	
	香港・オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	15,020,000.00	14,827,744.00	
		CGB 2.47% 09/02/24	3,600,000.00	3,617,280.00	
		CGB 2.56% 10/21/23	15,660,000.00	15,766,644.60	
		CGB 2.68% 05/21/30	9,780,000.00	9,689,046.00	
		CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,797,722.00	
		CGB 2.85% 06/04/27	12,330,000.00	12,517,169.40	
		CGB 2.91% 10/14/28	4,750,000.00	4,814,220.00	
		CGB 3.01% 05/13/28	1,050,000.00	1,071,556.50	
		CGB 3.02% 05/27/31	2,900,000.00	2,959,508.00	
		CGB 3.03% 03/11/26	14,760,000.00	15,103,612.80	
		CGB 3.27% 11/19/30	3,950,000.00	4,105,748.50	
		CGB 3.28% 12/03/27	1,060,000.00	1,102,188.00	
		CGB 3.39% 03/16/50	5,520,000.00	5,541,859.20	
		CGB 3.53% 10/18/51	650,000.00	678,970.50	
		CGB 3.72% 04/12/51	540,000.00	577,060.20	
		CGB 3.81% 09/14/50	920,000.00	996,203.60	
		CGB 3.86% 07/22/49	760,000.00	825,937.60	
		CGB 4.08% 10/22/48	4,110,000.00	4,639,450.20	
	香港・オフショア人民元 小計		109,010,000.00	110,631,921.10 (1,991,496,274)	
合計				296,954,980,057 (296,954,980,057)	

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　　219銘柄	100.0%	47.4%
カナダドル	国債証券　　32銘柄	100.0%	2.0%

メキシコペソ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券　337銘柄	100.0%	38.8%
イギリスポンド	国債証券　54銘柄	100.0%	5.9%
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%	0.5%
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　19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券　30銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券　14銘柄	100.0%	0.4%
香港・オフショア人民元	国債証券　18銘柄	100.0%	0.7%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月 20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,982,564,563
コール・ローン	1,611,216,265
株式	496,932,605,771
投資信託受益証券	286,914,422
投資証券	11,459,377,813
派生商品評価勘定	36,342,183
未収入金	△1
未収配当金	303,442,435
前払金	150,522,201
差入委託証拠金	1,362,153,783
流動資産合計	519,125,139,435
資産合計	519,125,139,435
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	188,217,377

未払解約金	1,052,475,375
未払利息	2,415
流動負債合計	1,240,695,167
負債合計	1,240,695,167
純資産の部	
元本等	
元本	125,379,065,422
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	392,505,378,846
元本等合計	517,884,444,268
純資産合計	517,884,444,268
負債純資産合計	519,125,139,435

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月 20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨

	建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2022年 1月 20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	125,379,065,422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 4.1305円 (1万口当たり純資産額) (41,305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 1月 20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

	「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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 1月 20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月 21日
期首元本額	146,425,163,104円
期中追加設定元本額	13,345,927,484円
期中一部解約元本額	34,392,025,166円
期末元本額	125,379,065,422円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,888,139,255円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	7,121,235円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	30,124,202,302円
世界経済インデックスファンド	9,577,066,256円
外国株式インデックス・オープン	844,357,673円
ＤＣマイセレクション２５	820,311,369円
ＤＣマイセレクション５０	3,838,482,563円
ＤＣマイセレクション７５	4,401,337,576円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	11,671,773,715円
ＤＣマイセレクションＳ２５	397,448,857円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,818,968,962円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,524,794,553円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	52,371,368円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	165,230,872円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	118,814,732円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,504,209,076円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,667,254,267円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,370,105円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	4,613,649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）	30,784,916円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	16,645,660円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	59,655,188円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	11,656,656円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	38,621,871円

バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	314,575,085円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	186,426,802円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,365,542,500円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	173,287,225円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	35,625,550円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	181,169,829円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	60,531,925円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	1,153,399,892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）	1,193,867,847円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,153,299,782円
コア投資戦略ファンド（安定型）	709,679,705円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,532,976,315円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,458,128,299円
分散投資コア戦略ファンドＳ	8,127,220,507円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,237,650,305円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,065,193,705円
コア投資戦略ファンド（切替型）	658,548,355円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	599,690,957円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,266,580円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	158,957,370円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	431,357,615円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	17,488,738,858円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	174,573,949円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	643,957,427円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	125,114,641円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,776,110円
ｉ－ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	152,792,028円
グローバル経済コア	649,159,006円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	12,587,631円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	4,853,834円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	480,458,252円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	63,437,074円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	18,457,901円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	12,680,293円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	6,567,996円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	7,205,423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）	342,046,177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）	514,529,362円
外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,056,919,591円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,091,055,460円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	195,849,150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）	111,785,723円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	44,450,123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）	80,706,930円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	248,911,281円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	260,033,035円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	252,448,023円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	250,931,421円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	239,889,089円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	236,166,458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）	194,354,350円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 1月 20日現在

	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	28,215,953,716
投資信託受益証券	19,727,833
投資証券	916,257,055
合計	29,151,938,604

(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 1月 20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	8,481,294,417	―	8,330,772,216	△150,522,201
合計		8,481,294,417	―	8,330,772,216	△150,522,201

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2022年 1月 20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	439,050,817	―	437,732,484	△1,318,333
	アメリカドル	281,039,500	―	280,056,560	△982,940
	カナダドル	80,527,526	―	80,274,486	△253,040
	イギリスポンド	77,483,791	―	77,401,438	△82,353
	売建	769,701,500	―	769,736,160	△34,660
	アメリカドル	457,200,000	―	457,220,800	△20,800
	ユーロ	142,728,300	―	142,741,280	△12,980
	イギリスポンド	62,284,000	―	62,291,640	△7,640
	オーストラリアドル	107,489,200	―	107,482,440	6,760
合計		1,208,752,317	―	1,207,468,644	△1,352,993

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	69,980	26.29	1,839,774.20	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	108.33	2,061,953.22	
	CHEVRON CORP	153,051	128.91	19,729,804.41	
	CONOCOPHILLIPS	107,649	87.28	9,395,604.72	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	20.88	1,336,320.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	51,677	48.93	2,528,555.61	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	125.71	1,667,794.57	
	EOG RESOURCES INC	46,119	105.13	4,848,490.47	
	EXXON MOBIL	334,998	73.11	24,491,703.78	
	HALLIBURTON CO	68,269	28.38	1,937,474.22	
	HESS CORP	22,781	91.23	2,078,310.63	
	KINDER MORGAN INC	159,310	17.43	2,776,773.30	
	MARATHON PETROLEUM CORP	49,827	73.35	3,654,810.45	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,966	35.83	2,506,881.78	
	ONEOK INC	33,279	60.21	2,003,728.59	
	PHILLIPS 66	35,503	87.24	3,097,281.72	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,224	219.06	3,992,149.44	
	SCHLUMBERGER	107,126	37.10	3,974,374.60	
	VALERO ENERGY CORP	30,763	84.21	2,590,552.23	
	WILLIAMS COS	98,553	29.03	2,860,993.59	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,541	285.57	5,009,183.37	
	ALBEMARLE CORP	9,440	219.69	2,073,873.60	
	AMCOR PLC	111,485	12.41	1,383,528.85	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	206.25	1,369,087.50	
	BALL CORP	25,605	91.75	2,349,258.75	
	CELANESE CORP-SERIES A	8,582	168.10	1,442,634.20	

	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,951	66.90	1,000,221.90	
	CORTEVA INC	58,500	47.22	2,762,370.00	
	CROWN HOLDINGS INC	11,212	116.48	1,305,973.76	
	DOW INC	60,946	59.84	3,647,008.64	
	DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	81.58	3,343,148.40	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	127.51	1,412,173.25	
	ECOLAB INC	19,895	214.80	4,273,446.00	
	FMC CORP	10,507	111.05	1,166,802.35	
	FREEPORT-MCMORAN INC	113,194	44.08	4,989,591.52	
	INT'L PAPER CO	30,800	49.35	1,519,980.00	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,494	139.38	2,717,073.72	
	LINDE PLC	40,841	322.19	13,158,561.79	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,803	100.88	1,997,726.64	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,631	390.36	1,807,757.16	
	MOSAIC CO/THE	31,911	41.94	1,338,347.34	
	NEWMONT CORPORATION	65,375	64.95	4,246,106.25	
	NUCOR CORP	23,355	104.25	2,434,758.75	
	PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	137.12	1,054,041.44	
	PPG INDUSTRIES INC	19,278	161.55	3,114,360.90	
	RPM INTERNATIONAL INC	10,456	90.53	946,581.68	
	SEALED AIR CORP	11,690	68.64	802,401.60	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,719	303.79	5,990,435.01	
	STEEL DYNAMICS INC	15,552	58.96	916,945.92	
	VULCAN MATERIALS CO	10,247	188.22	1,928,690.34	
	WESTROCK CO	21,356	46.27	988,142.12	
	3 M COMPANY	46,302	178.48	8,263,980.96	
	ALLEGION PLC	7,601	122.93	934,390.93	
	AMETEK INC	18,006	138.84	2,499,953.04	
	BOEING CO	44,447	217.08	9,648,554.76	
	CARRIER GLOBAL CORP	67,383	48.79	3,287,616.57	
	CATERPILLAR	43,764	221.66	9,700,728.24	
	CUMMINS INC	11,214	231.10	2,591,555.40	
	DEERE&CO	23,252	375.90	8,740,426.80	
	DOVER CORP	10,672	177.60	1,895,347.20	
	EATON CORP	31,624	163.39	5,167,045.36	
	EMERSON ELECTRIC CO	46,305	94.92	4,395,270.60	

	FASTENAL CO	44,846	58.02	2,601,964.92	
	FORTIVE CORP	25,722	72.24	1,858,157.28	
	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	96.95	999,554.50	
	GENERAC HOLDINGS INC	5,211	291.36	1,518,276.96	
	GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	210.36	3,990,529.20	
	GENERAL ELECTRIC CO	87,737	100.62	8,828,096.94	
	GRAINGER (WW) INC	3,236	497.31	1,609,295.16	
	HEICO CORP	3,640	146.85	534,534.00	
	HEICO CORP-CLASS A	6,449	124.45	802,578.05	
	HONEYWELL INTL INC	54,581	210.73	11,501,854.13	
	HOWMET AEROSPACE INC	31,594	33.83	1,068,825.02	
	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	193.68	682,140.96	
	IDEX CORP	5,916	216.10	1,278,447.60	
	ILLINOIS TOOL WORKS	25,097	242.23	6,079,246.31	
	INGERSOLL-RAND INC	31,562	58.38	1,842,589.56	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	58.54	1,036,158.00	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	56,689	73.71	4,178,546.19	
	KORNIT DIGITAL LTD	2,776	103.60	287,593.60	
	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	227.67	3,570,776.28	
	LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	290.77	734,485.02	
	LOCKHEED MARTIN CORP	19,938	377.33	7,523,205.54	
	MASCO CORP	19,462	65.59	1,276,512.58	
	NORDSON CORP	4,121	236.94	976,429.74	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	12,113	401.65	4,865,186.45	
	OTIS WORLDWIDE CORP	33,153	83.10	2,755,014.30	
	OWENS CORNING	8,642	91.30	789,014.60	
	PACCAR INC	28,106	94.16	2,646,460.96	
	PARKER HANNIFIN CORP	10,508	323.09	3,395,029.72	
	PENTAIR PLC	14,533	66.30	963,537.90	
	PLUG POWER INC	41,884	20.99	879,145.16	
	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	119,143	89.70	10,687,127.10	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	9,098	315.63	2,871,601.74	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	8,314	442.48	3,678,778.72	
	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	60.40	835,211.20	
	SMITH (A.O.) CORP	9,016	79.55	717,222.80	
	SNAP-ON INC	4,000	212.61	850,440.00	

	STANLEY BLACK&DECKER	12,598	182.18	2,295,103.64	
	SUNRUN INC	13,917	27.71	385,640.07	
	TEXTRON	18,893	74.81	1,413,385.33	
	TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	175.70	3,274,696.60	
	TRANSDIGM GROUP INC	4,075	630.25	2,568,268.75	
	UNITED RENTALS INC	5,393	307.30	1,657,268.90	
	WABTEC CORP	15,024	91.92	1,381,006.08	
	XYLEM INC	13,269	108.51	1,439,819.19	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	87.05	989,236.20	
	CINTAS CORP	7,423	387.84	2,878,936.32	
	CLARIVATE PLC	27,357	16.36	447,560.52	
	COPART INC	16,617	131.90	2,191,782.30	
	COSTAR GROUP INC	32,116	73.15	2,349,285.40	
	EQUIFAX INC	9,509	233.92	2,224,345.28	
	IHS MARKIT LTD	30,929	119.17	3,685,808.93	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	128.98	1,375,055.78	
	LEIDOS HOLDINGS	11,220	93.63	1,050,528.60	
	REPUBLIC SERVICES INC	18,483	129.15	2,387,079.45	
	ROBERT HALF INTL INC	9,566	110.74	1,059,338.84	
	ROLLINS INC	17,468	31.99	558,801.32	
	TRANSUNION	15,741	104.12	1,638,952.92	
	VERISK ANALYTICS INC	12,503	199.86	2,498,849.58	
	WASTE CONNECTIONS INC	21,275	124.53	2,649,375.75	
	WASTE MANAGEMENT INC	32,770	155.08	5,081,971.60	
	AMERCO	734	647.23	475,066.82	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	107.51	1,214,002.92	
	CSX CORP	176,986	35.25	6,238,756.50	
	DELTA AIR LINES INC	14,609	38.82	567,121.38	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	119.02	1,698,653.44	
	FEDEX CORP	19,524	252.19	4,923,757.56	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	200.65	1,414,983.80	
	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	57.34	613,538.00	
	LYFT INC-A	21,288	36.91	785,740.08	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	19,853	278.06	5,520,325.18	
	OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	312.43	2,500,377.29	
	SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	44.43	601,271.19	

	UBER TECHNOLOGIES INC	93,848	37.86	3,553,085.28	
	UNION PACIFIC CORP	51,560	239.49	12,348,104.40	
	UNITED PARCEL SERVICE B	57,890	203.76	11,795,666.40	
	APTIV PLC	22,055	145.88	3,217,383.40	
	BORGWARNER INC	19,781	46.48	919,420.88	
	FORD MOTOR COMPANY	305,209	22.45	6,851,942.05	
	GENERAL MOTORS CO	103,796	56.24	5,837,487.04	
	LEAR CORP	5,287	178.84	945,527.08	
	LUCID GROUP INC	31,234	40.03	1,250,297.02	
	RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,363	69.40	927,392.20	
	TESLA INC	66,715	995.65	66,424,789.75	
	DR HORTON INC	27,764	90.33	2,507,922.12	
	GARMIN LTD	12,854	131.23	1,686,830.42	
	HASBRO INC	10,572	99.13	1,048,002.36	
	LENNAR CORP-CL A	22,762	96.86	2,204,727.32	
	LULULEMON ATHLETICA INC	9,305	330.95	3,079,489.75	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	161.88	819,436.56	
	NEWELL BRANDS INC	31,461	23.30	733,041.30	
	NIKE B	100,716	145.11	14,614,898.76	
	NVR INC	247	5,355.00	1,322,685.00	
	PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	31.84	692,074.24	
	PULTE GROUP INC	21,609	53.10	1,147,437.90	
	VF CORP	25,718	70.41	1,810,804.38	
	WHIRLPOOL CORP	5,220	206.87	1,079,861.40	
	AIRBNB INC-CLASS A	18,489	154.58	2,858,029.62	
	ARAMARK	20,955	34.49	722,737.95	
	BOOKING HOLDINGS INC	3,268	2,377.09	7,768,330.12	
	CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	77.80	1,366,168.00	
	CARNIVAL CORPORATION	70,520	21.22	1,496,434.40	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,164	1,467.68	3,176,059.52	
	DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	138.56	1,484,254.72	
	DOMINO'S PIZZA INC	2,848	469.39	1,336,822.72	
	DRAFTKINGS INC - CL A	27,674	21.40	592,223.60	
	EXPEDIA GROUP INC	11,638	176.46	2,053,641.48	
	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,878	142.21	3,111,270.38	
	LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	43.92	1,289,930.40	

	MARRIOTT INTL A	21,139	154.20	3,259,633.80	
	MCDONALD'S CORP	59,079	255.22	15,078,142.38	
	MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	11.08	195,694.96	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,064	42.21	1,395,631.44	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,267	81.63	1,572,765.21	
	STARBUCKS CORP	94,298	96.87	9,134,647.26	
	VAIL RESORTS INC	3,014	287.84	867,549.76	
	WYNN RESORTS LTD	9,302	89.06	828,436.12	
	YUM BRANDS INC	24,252	124.50	3,019,374.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	61,643	82.15	5,063,972.45	
	ALPHABET INC-CL A	23,897	2,702.33	64,577,580.01	
	ALPHABET INC-CL C	22,844	2,713.04	61,976,685.76	
	AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	38,290	18.32	701,472.80	
	CABLE ONE INC	445	1,582.31	704,127.95	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	10,148	581.30	5,899,032.40	
	COMCAST CORP-CL A	362,493	50.33	18,244,272.69	
	DISCOVERY INC - A	12,804	28.58	365,938.32	
	DISCOVERY INC-C	28,190	27.78	783,118.20	
	DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	34.05	685,494.60	
	ELECTRONIC ARTS INC	23,411	136.91	3,205,200.01	
	FOX CORP - CLASS A	27,658	39.66	1,096,916.28	
	FOX CORP- CLASS B	15,092	36.48	550,556.16	
	IAC/INTERACTIVECORP	6,721	131.80	885,827.80	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	36.48	1,234,264.32	
	LIBERTY BROADBAND-A	2,579	142.05	366,346.95	
	LIBERTY BROADBAND-C	11,268	144.76	1,631,155.68	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	61.93	952,421.47	
	LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	47.72	648,228.48	
	LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	47.67	304,325.28	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	113.28	1,575,498.24	
	MATCH GROUP INC	20,191	116.27	2,347,607.57	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	188,974	319.59	60,394,200.66	
	NETFLIX INC	35,107	515.86	18,110,297.02	
	NEWS CORP-CLASS A	33,479	22.03	737,542.37	
	OMNICOM GROUP	18,031	76.97	1,387,846.07	
	PINTEREST INC- CLASS A	45,767	31.64	1,448,067.88	

	ROKU INC	9,122	166.49	1,518,721.78	
	SEA LTD-ADR	10,483	167.83	1,759,361.89	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	6.10	368,854.80	
	SNAP INC - A	83,375	35.05	2,922,293.75	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,738	163.36	1,590,799.68	
	THE WALT DISNEY CO	143,808	150.11	21,587,018.88	
	TWITTER INC	63,066	37.35	2,355,515.10	
	VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	35.07	1,703,911.02	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	17,304	48.97	847,376.88	
	ADVANCE AUTO PARTS	5,324	234.34	1,247,626.16	
	AMAZON.COM	36,161	3,125.98	113,038,562.78	
	AUTOZONE INC	1,639	1,945.89	3,189,313.71	
	BATH & BODY WORKS INC	19,806	55.57	1,100,619.42	
	BEST BUY COMPANY INC	18,175	99.35	1,805,686.25	
	BURLINGTON STORES INC	5,108	224.00	1,144,192.00	
	CARMAX INC	12,051	107.63	1,297,049.13	
	CARVANA CO	5,700	157.13	895,641.00	
	CHEWY INC - CLASS A	6,878	42.19	290,182.82	
	DOLLAR GENERAL CORP	18,686	219.94	4,109,798.84	
	DOLLAR TREE INC	17,931	131.32	2,354,698.92	
	DOORDASH INC - A	8,334	131.76	1,098,087.84	
	EBAY	51,021	62.29	3,178,098.09	
	ETSY INC	10,294	163.14	1,679,363.16	
	FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,486	82.50	122,595.00	
	GENUINE PARTS CO	12,119	134.35	1,628,187.65	
	HOME DEPOT	83,616	359.69	30,075,839.04	
	LKQ CORP	22,779	54.74	1,246,922.46	
	LOWES COMPANIES	54,763	234.70	12,852,876.10	
	MERCADOLIBRE INC	3,567	1,060.94	3,784,372.98	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,407	659.59	3,566,403.13	
	POOL CORP	3,304	490.66	1,621,140.64	
	ROSS STORES INC	28,076	99.03	2,780,366.28	
	TARGET (DAYTON HUDSON)	38,552	223.84	8,629,479.68	
	TJX COMPANIES INC	96,126	68.51	6,585,592.26	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	220.66	1,968,728.52	
	ULTA BEAUTY INC	3,990	371.68	1,483,003.20	

	WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	156.02	936,120.00	
	COSTCO WHOLESALE CORP	34,970	490.16	17,140,895.20	
	KROGER CO	56,126	48.58	2,726,601.08	
	SYSCO CORP	40,288	77.69	3,129,974.72	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	53.53	3,199,327.51	
	WALMART INC	122,250	143.94	17,596,665.00	
	ALTRIA GROUP INC	147,613	50.09	7,393,935.17	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,402	71.00	3,223,542.00	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	66.77	1,602,880.62	
	BUNGE LIMITED	11,604	96.76	1,122,803.04	
	CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	46.04	730,608.76	
	COCA-COLA CO	323,723	61.00	19,747,103.00	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	58.26	896,854.44	
	CONAGRA BRANDS INC	41,157	35.56	1,463,542.92	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	242.81	3,141,961.40	
	GENERAL MILLS INC	49,646	69.15	3,433,020.90	
	HERSHEY FOODS CORPORATION	11,352	199.64	2,266,313.28	
	HORMEL FOODS CORP	23,338	49.15	1,147,062.70	
	JM SMUCKER CO	9,145	143.40	1,311,393.00	
	KELLOGG CO	21,630	66.60	1,440,558.00	
	KEURIG DR PEPPER INC	52,526	38.38	2,015,947.88	
	KRAFT HEINZ CO/THE	52,188	37.22	1,942,437.36	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	96.06	2,025,713.28	
	MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	50.24	736,970.56	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	111,937	67.60	7,566,941.20	
	MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	86.73	2,798,516.91	
	PEPSICO INC	109,176	175.21	19,128,726.96	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,866	101.49	12,672,650.34	
	TYSON FOODS INC	21,804	92.71	2,021,448.84	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	17,995	102.93	1,852,225.35	
	CLOROX COMPANY	9,570	181.13	1,733,414.10	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	63,788	84.06	5,362,019.28	
	ESTEE LAUDER CO-CL A	18,438	309.52	5,706,929.76	
	KIMBERLY-CLARK CORP	27,550	142.68	3,930,834.00	
	PROCTER & GAMBLE CO	192,348	162.00	31,160,376.00	
	ABBOTT LABORATORIES	140,430	126.05	17,701,201.50	

	ABIOMED INC	3,781	302.02	1,141,937.62	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	497.59	2,957,177.37	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	132.39	1,707,301.44	
	ANTHEM INC	19,533	448.29	8,756,448.57	
	BAXTER INTERNATIONAL	40,994	85.60	3,509,086.40	
	BECTON DICKINSON & CO	23,131	263.87	6,103,576.97	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,802	44.05	4,968,928.10	
	CARDINAL HEALTH	24,692	52.07	1,285,712.44	
	CENTENE CORP	44,550	77.61	3,457,525.50	
	CERNER CORP	22,894	91.77	2,100,982.38	
	CIGNA CORP	27,283	238.80	6,515,180.40	
	CVS HEALTH CORP	105,249	103.45	10,888,009.05	
	DAVITA INC	5,784	109.62	634,042.08	
	DENTSPLY SIRONA INC	17,774	53.02	942,377.48	
	DEXCOM INC	7,647	435.23	3,328,203.81	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,336	116.16	5,614,709.76	
	HCA HEALTHCARE INC	20,149	245.33	4,943,154.17	
	HENRY SCHEIN INC	11,747	74.55	875,738.85	
	HOLOGIC INC	21,687	70.42	1,527,198.54	
	HUMANA INC	9,953	377.84	3,760,641.52	
	IDEXX LABORATORIES INC	6,751	519.13	3,504,646.63	
	INMODE LTD	5,500	44.92	247,060.00	
	INSULET CORP	5,311	235.02	1,248,191.22	
	INTUITIVE SURGICAL INC	28,389	293.46	8,331,035.94	
	LABORATORY CRP OF AMER	7,595	272.02	2,065,991.90	
	MASIMO CORP	4,147	223.25	925,817.75	
	MCKESSON CORP	12,089	251.15	3,036,152.35	
	MEDTRONIC PLC	106,382	107.76	11,463,724.32	
	MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	280.44	1,385,373.60	
	NOVOCURE LTD	7,933	64.18	509,139.94	
	OAK STREET HEALTH INC	7,613	19.50	148,453.50	
	QUEST DIAGNOSTICS	10,005	138.98	1,390,494.90	
	RESMED INC	11,440	241.39	2,761,501.60	
	STERIS PLC	8,018	231.86	1,859,053.48	
	STRYKER CORP	27,043	258.30	6,985,206.90	
	TELADOC HEALTH INC	11,375	75.51	858,926.25	

	TELEFLEX INC	3,934	332.86	1,309,471.24	
	THE COOPER COS INC	4,134	398.15	1,645,952.10	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	74,840	462.52	34,614,996.80	
	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,102	129.42	789,720.84	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	220.13	2,477,563.15	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,300	123.27	2,132,571.00	
	10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	89.64	506,914.20	
	ABBVIE INC	139,675	135.21	18,885,456.75	
	AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	140.43	3,340,127.55	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	138.62	1,336,712.66	
	AMGEN	44,845	231.30	10,372,648.50	
	AVANTOR INC	42,980	37.15	1,596,707.00	
	BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	598.44	1,108,909.32	
	BIO-TECHNE CORP	3,245	379.83	1,232,548.35	
	BIOGEN INC	11,860	230.81	2,737,406.60	
	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	86.00	1,271,338.00	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	175,578	64.72	11,363,408.16	
	CATALENT INC	13,739	102.56	1,409,071.84	
	CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	336.68	1,415,402.72	
	DANAHER CORP	50,501	287.03	14,495,302.03	
	ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	26.39	951,649.79	
	EXACT SCIENCES CORP	14,756	76.13	1,123,374.28	
	GILEAD SCIENCES INC	100,025	69.07	6,908,726.75	
	HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	88.04	1,578,205.04	
	ILLUMINA INC	11,258	384.36	4,327,124.88	
	INCYTE CORP	15,212	74.78	1,137,553.36	
	IQVIA HOLDINGS INC	15,126	240.28	3,634,475.28	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	140.64	699,121.44	
	JOHNSON & JOHNSON	208,850	166.58	34,790,233.00	
	LILLY (ELI) & CO	64,377	245.05	15,775,583.85	
	MERCK & CO	200,094	81.29	16,265,641.26	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,469.07	2,656,078.56	
	MODERNA INC	27,309	174.07	4,753,677.63	
	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	72.83	617,161.42	
	NOVAVAX INC	5,754	92.33	531,266.82	
	PERKINELMER INC	9,372	176.80	1,656,969.60	

	PFIZER	442,966	53.54	23,716,399.64	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	8,116	618.11	5,016,580.76	
	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,128	39.97	1,044,336.16	
	SEAGEN INC	10,071	132.55	1,334,911.05	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	8.84	710,744.84	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,080	593.37	18,441,939.60	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,153	230.84	4,882,958.52	
	VIATRIS INC	103,541	14.72	1,524,123.52	
	WATERS CORP	4,749	324.46	1,540,860.54	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	375.45	2,165,220.15	
	ZOETIS INC	37,880	200.58	7,597,970.40	
	BANK OF AMERICA CORP	599,876	46.44	27,858,241.44	
	CITIGROUP	160,167	64.24	10,289,128.08	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	54.36	1,959,188.76	
	FIFTH THIRD BANCORP	57,022	47.97	2,735,345.34	
	FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	897.89	852,995.50	
	FIRST REPUBLIC BANK/CA	13,787	174.03	2,399,351.61	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	17.11	1,952,456.32	
	JPMORGAN CHASE & CO	236,784	148.93	35,264,241.12	
	KEY CORP	71,472	25.59	1,828,968.48	
	M & T BANK CORP	10,537	175.92	1,853,669.04	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	33,857	208.52	7,059,861.64	
	REGIONS FINL CORP	70,814	23.65	1,674,751.10	
	SIGNATURE BANK	4,686	351.43	1,646,800.98	
	SVB FINANCIAL GROUP	4,545	655.00	2,976,975.00	
	TRUIST FINANCIAL CORP	107,118	64.58	6,917,680.44	
	US BANCORP	112,812	57.37	6,472,024.44	
	WELLS FARGO & CO	326,420	55.57	18,139,159.40	
	ALLY FINANCIAL INC	27,761	48.99	1,360,011.39	
	AMERICAN EXPRESS	53,334	161.39	8,607,574.26	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,404	311.83	2,932,449.32	
	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	26,880	67.05	1,802,304.00	
	BANK NEW YORK CO	64,343	59.24	3,811,679.32	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,144	314.75	33,094,074.00	
	BLACKROCK INC	12,198	825.50	10,069,449.00	
	BLACKSTONE INC	54,507	112.26	6,118,955.82	

	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	35,046	151.61	5,313,324.06	
	CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	50.59	637,181.05	
	CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	120.29	1,067,573.75	
	CME GROUP INC	28,556	229.62	6,557,028.72	
	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,868	219.50	629,526.00	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	23,403	118.50	2,773,255.50	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	34.39	1,128,507.85	
	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	429.50	1,352,066.00	
	FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	33.82	881,687.40	
	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	48.50	209,326.00	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,636	347.32	9,251,215.52	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,703	125.81	5,624,084.43	
	INVESCO LTD	26,420	23.25	614,265.00	
	KKR & CO INC	39,913	66.88	2,669,381.44	
	MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	373.42	1,197,557.94	
	MOODY'S CORP	13,365	346.63	4,632,709.95	
	MORGAN STANLEY	108,132	95.73	10,351,476.36	
	MSCI INC	6,518	513.40	3,346,341.20	
	NASDAQ INC	9,657	181.11	1,748,979.27	
	NORTHERN TRUST CORP	15,902	125.84	2,001,107.68	
	PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	167.79	3,004,615.53	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	102.21	1,582,824.06	
	ROBINHOOD MARKETS INC - A	13,050	13.89	181,264.50	
	S&P GLOBAL INC	19,238	422.95	8,136,712.10	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	115,518	91.51	10,571,052.18	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	59.92	572,236.00	
	SOFI TECHNOLOGIES INC	38,996	13.71	534,635.16	
	STATE STREET CORP	29,894	93.88	2,806,448.72	
	SYNCHRONY FINANCIAL	45,369	45.64	2,070,641.16	
	TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	91.00	824,551.00	
	UPSTART HOLDINGS INC	1,362	106.01	144,385.62	
	AFLAC	50,591	62.76	3,175,091.16	
	ALLEGHANY CORP	906	660.50	598,413.00	
	ALLSTATE CORP	23,095	120.93	2,792,878.35	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	130.57	825,071.83	
	AMERICAN INT'L GROUP	65,898	58.84	3,877,438.32	

	AON PLC	17,508	270.63	4,738,190.04	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	45.92	1,562,703.52	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	154.59	2,528,937.81	
	ASSURANT INC	4,726	151.53	716,130.78	
	BROWN & BROWN INC	19,873	64.63	1,284,391.99	
	CHUBB LTD	34,591	191.88	6,637,321.08	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	114.97	1,470,581.27	
	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	176.21	381,670.86	
	EVEREST RE GROUP LTD	3,288	287.34	944,773.92	
	FNF GROUP	20,461	52.76	1,079,522.36	
	GLOBE LIFE INC	8,106	104.10	843,834.60	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS	27,721	70.46	1,953,221.66	
	LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	71.38	962,487.92	
	LOEWS CORP	18,851	59.59	1,123,331.09	
	MARKEL CORP	1,156	1,237.74	1,430,827.44	
	MARSH & MCLENNAN COS	40,497	158.27	6,409,460.19	
	METLIFE INC	57,127	66.76	3,813,798.52	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	74.59	1,545,430.21	
	PROGRESSIVE CORP	45,110	107.63	4,855,189.30	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,037	113.19	3,513,078.03	
	TRAVELERS COS INC/THE	19,772	160.07	3,164,904.04	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,061	226.56	2,279,420.16	
	WR BERKLEY CORP	11,715	82.53	966,838.95	
	CBRE GROUP INC-A	25,382	98.89	2,510,025.98	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	5.50	542,850.00	
	WEYERHAEUSER CO	58,295	39.18	2,283,998.10	
	ZILLOW GROUP INC-A	5,497	53.05	291,615.85	
	ZILLOW GROUP INC-C	13,427	54.22	728,011.94	
	ACCENTURE PLC-CL A	50,238	343.74	17,268,810.12	
	ADOBE INC	37,856	516.58	19,555,652.48	
	AFFIRM HOLDINGS INC	6,631	64.30	426,373.30	
	AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	13,673	113.17	1,547,373.41	
	ANSYS INC	6,794	337.10	2,290,257.40	
	ASANA INC - CL A	4,986	53.08	264,656.88	
	AUTODESK INC	17,467	254.35	4,442,731.45	
	AUTOMATIC DATA PROCESS	33,910	224.83	7,623,985.30	

	AVALARA INC	6,847	103.92	711,540.24	
	BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	38.88	544,164.48	
	BILL.COM HOLDINGS INC	5,794	167.94	973,044.36	
	BLACK KNIGHT INC	11,543	73.91	853,143.13	
	BLOCK INC	31,267	128.14	4,006,553.38	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	160.48	1,563,396.16	
	CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,922	153.17	3,357,792.74	
	CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	79.40	847,039.20	
	CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	124.88	1,014,525.12	
	CITRIX SYSTEMS INC	10,444	104.70	1,093,486.80	
	CLOUDFLARE INC - CLASS A	18,620	94.32	1,756,238.40	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	42,997	86.04	3,699,461.88	
	COUPA SOFTWARE INC	6,059	133.09	806,392.31	
	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,466	175.71	2,717,530.86	
	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	141.77	439,487.00	
	DATADOG INC - CLASS A	15,147	130.91	1,982,893.77	
	DOCUSIGN INC	14,969	126.99	1,900,913.31	
	DROPBOX INC-CLASS A	28,845	24.49	706,414.05	
	DYNATRACE INC	14,790	50.55	747,634.50	
	EPAM SYSTEMS INC	4,403	493.98	2,174,993.94	
	FAIR ISAAC CORP	2,125	438.80	932,450.00	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	48,175	113.30	5,458,227.50	
	FISERV INC	46,421	106.05	4,922,947.05	
	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,523	237.58	1,549,734.34	
	FORTINET INC	10,645	307.16	3,269,718.20	
	GARTNER INC	6,968	280.05	1,951,388.40	
	GLOBAL PAYMENTS INC	24,126	145.86	3,519,018.36	
	GODADDY INC - CLASS A	13,798	73.72	1,017,188.56	
	GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	101.66	642,287.88	
	HUBSPOT INC	3,646	452.96	1,651,492.16	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,479	131.58	9,405,206.82	
	INTUIT INC	21,612	545.35	11,786,104.20	
	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	166.42	1,046,948.22	
	MASTERCARD INC-CLASS A	70,070	360.73	25,276,351.10	
	MICROSOFT CORP	566,188	303.33	171,741,806.04	
	MONGODB INC	4,623	384.59	1,777,959.57	

	NORTONLIFELOCK INC	50,376	26.36	1,327,911.36	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,967	55.24	1,268,697.08	
	OKTA INC	10,230	197.42	2,019,606.60	
	ORACLE CORP	132,454	83.38	11,044,014.52	
	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	14.56	1,823,552.64	
	PALO ALTO NETWORKS INC	7,648	519.61	3,973,977.28	
	PAYCHEX INC	25,433	121.27	3,084,259.91	
	PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	329.76	1,396,533.60	
	PAYPAL HOLDINGS INC	88,224	173.55	15,311,275.20	
	PTC INC	8,304	117.36	974,557.44	
	RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	168.77	1,078,946.61	
	SALESFORCE.COM INC	77,524	226.27	17,541,355.48	
	SERVICENOW INC	15,788	521.29	8,230,126.52	
	SNOWFLAKE INC-CLASS A	16,606	282.56	4,692,191.36	
	SPLUNK INC	13,355	118.78	1,586,306.90	
	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	81.84	1,582,376.40	
	SYNOPSYS INC	12,038	312.14	3,757,541.32	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,090	69.00	2,283,210.00	
	TWILIO INC - A	12,842	203.69	2,615,786.98	
	TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	466.74	1,558,444.86	
	UNITY SOFTWARE INC	4,329	113.07	489,480.03	
	VERISIGN INC	7,790	217.24	1,692,299.60	
	VISA INC-CLASS A SHARES	134,076	214.68	28,783,435.68	
	VMWARE INC-CLASS A	16,717	124.21	2,076,418.57	
	WESTERN UNION CO	29,297	18.77	549,904.69	
	WIX.COM LTD	5,010	134.22	672,442.20	
	WORKDAY INC-CLASS A	15,585	249.46	3,887,834.10	
	ZENDESK INC	10,500	97.57	1,024,485.00	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,028	157.23	2,677,312.44	
	ZSCALER INC	6,234	253.11	1,577,887.74	
	AMPHENOL CORPORATION	48,807	78.51	3,831,837.57	
	APPLE INC	1,311,983	166.23	218,090,934.09	
	ARISTA NETWORKS INC	18,880	125.31	2,365,852.80	
	ARROW ELECTRONICS INC	6,100	128.44	783,484.00	
	CDW CORP/DE	10,882	189.40	2,061,050.80	
	CISCO SYSTEMS	333,162	58.90	19,623,241.80	

	COGNEX CORP	14,352	68.85	988,135.20	
	CORNING	64,989	35.96	2,337,004.44	
	DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	57.96	1,302,998.76	
	F5 INC	4,150	222.80	924,620.00	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	16.74	1,827,154.26	
	HP INC	98,163	36.60	3,592,765.80	
	IPG PHOTONICS CORP	3,207	153.58	492,531.06	
	JUNIPER NETWORKS INC	25,321	33.57	850,025.97	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,989	180.45	2,704,765.05	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,961	244.25	3,165,724.25	
	NETAPP INC	18,303	89.41	1,636,471.23	
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,060	102.36	1,541,541.60	
	TE CONNECTIVITY LTD	26,068	156.99	4,092,415.32	
	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	416.80	1,625,103.20	
	TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	73.94	1,565,753.44	
	WESTERN DIGITAL CORP	25,790	61.94	1,597,432.60	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	513.11	2,135,563.82	
	AT&T INC	564,705	27.28	15,405,152.40	
	LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	27.44	425,759.04	
	LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	27.88	766,337.56	
	LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	12.10	892,604.90	
	T-MOBILE US INC	49,657	105.38	5,232,854.66	
	VERIZON COMMUNICATIONS	327,018	53.50	17,495,463.00	
	AES CORP	54,375	23.07	1,254,431.25	
	ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	59.42	1,234,628.76	
	AMEREN CORPORATION	20,898	87.64	1,831,500.72	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	38,104	90.30	3,440,791.20	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,174	161.02	2,282,297.48	
	ATMOS ENERGY CORP	11,419	105.34	1,202,877.46	
	CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	27.35	1,317,230.70	
	CMS ENERGY CORP	23,697	63.44	1,503,337.68	
	CONSOLIDATED EDISON INC	27,507	82.15	2,259,700.05	
	DOMINION ENERGY INC	62,375	79.03	4,929,496.25	
	DTE ENERGY COMPANY	16,240	118.67	1,927,200.80	
	DUKE ENERGY CORP	59,845	102.17	6,114,363.65	
	EDISON INTL	28,027	63.50	1,779,714.50	

	ENTERGY CORP	16,926	110.35	1,867,784.10	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	48.28	1,005,865.52	
	EVERGY INC	18,475	64.91	1,199,212.25	
	EVERSOURCE ENERGY	26,753	86.87	2,324,033.11	
	EXELON CORP	77,196	56.49	4,360,802.04	
	FIRSTENERGY CORP	45,787	41.42	1,896,497.54	
	NEXTERA ENERGY INC	155,150	82.59	12,813,838.50	
	NISOURCE INC	35,781	27.94	999,721.14	
	NRG ENERGY INC	19,068	39.87	760,241.16	
	PG&E CORP	118,132	12.64	1,493,188.48	
	PPL CORPORATION	63,429	29.82	1,891,452.78	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	65.55	2,587,127.40	
	SEMPRA ENERGY	25,825	135.87	3,508,842.75	
	SOUTHERN CO	84,113	68.33	5,747,441.29	
	UGI CORP	18,019	46.07	830,135.33	
	VISTRA CORP	37,797	22.48	849,676.56	
	WEC ENERGY GROUP INC	24,561	96.03	2,358,592.83	
	XCEL ENERGY INC	43,741	68.12	2,979,636.92	
	ADVANCED MICRO DEVICES	95,955	128.27	12,308,147.85	
	ANALOG DEVICES	42,907	163.06	6,996,415.42	
	APPLIED MATERIALS	71,368	143.07	10,210,619.76	
	BROADCOM INC	32,767	563.97	18,479,604.99	
	ENPHASE ENERGY INC	10,113	134.58	1,361,007.54	
	ENTEGRIS INC	10,491	127.42	1,336,763.22	
	INTEL CORP	318,822	53.62	17,095,235.64	
	KLA CORP	12,119	393.19	4,765,069.61	
	LAM RESEARCH CORP	11,353	642.73	7,296,913.69	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	63,360	76.89	4,871,750.40	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,808	76.66	3,434,981.28	
	MICRON TECHNOLOGY	89,326	90.00	8,039,340.00	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	413.97	1,461,728.07	
	NVIDIA CORP	197,988	250.67	49,629,651.96	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,848	210.95	4,397,885.60	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	31,766	59.01	1,874,511.66	
	QORVO INC	8,556	141.69	1,212,299.64	
	QUALCOMM	89,260	172.47	15,394,672.20	

	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	145.88	1,950,707.36	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	3,750	232.09	870,337.50	
	TERADYNE INC	12,318	148.32	1,827,005.76	
	TEXAS INSTRUMENTS	73,023	178.30	13,020,000.90	
	XILINX INC	19,302	189.09	3,649,815.18	
アメリカドル 小計		25,174,910		3,156,804,300.44 (360,854,299,583)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	27.29	733,555.20	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,194	66.26	6,175,034.44	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	18.58	1,796,054.28	
	ENBRIDGE	163,399	52.72	8,614,395.28	
	IMPERIAL OIL	16,573	51.52	853,840.96	
	KEYERA CORP	18,607	28.90	537,742.30	
	PARKLAND CORP	14,075	34.05	479,253.75	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	40.17	1,834,403.22	
	SUNCOR ENERGY	116,208	35.55	4,131,194.40	
	TC ENERGY CORP	77,328	63.65	4,921,927.20	
	TOURMALINE OIL CORP	22,173	47.65	1,056,543.45	
	AGNICO EAGLE MINES	20,293	67.90	1,377,894.70	
	BARRICK GOLD CORP	139,009	25.22	3,505,806.98	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	65.66	862,706.74	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,000	35.30	1,517,900.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	172.17	2,645,047.71	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	11.91	617,497.77	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	7.41	803,621.91	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	53.45	1,252,226.60	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	10.84	674,714.12	
	NUTRIEN LTD	44,786	92.31	4,134,195.66	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	31.16	573,686.76	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	40,561	43.21	1,752,640.81	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	120.33	938,574.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,238	52.83	1,808,793.54	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	13.07	257,792.68	
	CAE INC	25,999	31.91	829,628.09	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	107.28	826,592.40	
	WSP GLOBAL INC	8,602	170.87	1,469,823.74	

	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	41.27	557,351.35	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	78.01	799,212.45	
	THOMSON REUTERS CORP	13,293	134.29	1,785,116.97	
	AIR CANADA	13,805	22.37	308,817.85	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	55,489	154.05	8,548,080.45	
	CP RAILWAY LIMITED	73,737	94.91	6,998,378.67	
	TFI INTERNATIONAL INC	5,837	124.60	727,290.20	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	105.99	2,467,659.18	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	50.57	863,685.03	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	70.20	1,619,724.60	
	QUEBECOR INC -CL B	15,200	29.99	455,848.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	37.61	1,332,221.42	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,579	183.69	657,426.51	
	DOLLARAMA INC	22,000	63.08	1,387,760.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	66,914	50.48	3,377,818.72	
	EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	37.67	574,580.51	
	LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	95.77	1,236,678.01	
	METRO INC	18,840	66.48	1,252,483.20	
	WESTON (GEORGE) LTD	6,883	137.35	945,380.05	
	SAPUTO INC	14,489	27.34	396,129.26	
	BAUSCH HEALTH COS INC	20,800	31.99	665,392.00	
	CANOPY GROWTH CORP	20,989	9.53	200,025.17	
	BANK MONTREAL	51,389	146.61	7,534,141.29	
	BANK NOVA SCOTIA	96,500	91.10	8,791,150.00	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	34,494	163.33	5,633,905.02	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	99.60	2,717,984.40	
	ROYAL BANK OF CANADA	114,053	147.00	16,765,791.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	145,443	101.63	14,781,372.09	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC,CLASS-A	110,505	68.78	7,600,533.90	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	47.48	364,883.80	
	ONEX CORP	6,603	94.30	622,662.90	
	TMX GROUP LTD	4,685	126.06	590,591.10	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	622.96	1,328,773.68	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.66	919,644.08	
	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	79.67	804,587.33	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,312	161.30	2,147,225.60	

	MANULIFE FINANCIAL CORP	147,886	25.66	3,794,754.76	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	42.09	1,834,155.93	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	45,702	71.44	3,264,950.88	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	202.38	544,402.20	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	11.14	438,916.00	
	CGI INC - CL A	18,428	106.13	1,955,763.64	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	2,066.68	3,432,755.48	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	40.62	336,983.52	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	77.76	334,445.76	
	OPEN TEXT CORP	20,463	58.04	1,187,672.52	
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,030	1,289.82	11,647,074.60	
	BCE INC	6,203	66.29	411,196.87	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,584	62.18	1,901,713.12	
	TELUS CORP	32,908	29.76	979,342.08	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	17.71	917,696.78	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	26.88	655,737.60	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	41.77	471,792.15	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	35.53	366,811.72	
	EMERA INC	18,723	59.73	1,118,324.79	
	FORTIS INC	36,823	58.14	2,140,889.22	
	HYDRO ONE LTD	23,269	31.67	736,929.23	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	36.15	645,422.10	
カナダドル 小計		3,131,603		203,861,125.43 (18,639,022,698)	
ユーロ	ENI	197,669	13.42	2,652,717.98	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	9.82	483,380.24	
	NESTE OIL OYJ	32,126	43.64	1,401,978.64	
	OMV AG	12,549	56.08	703,747.92	
	REPSOL SA	111,112	11.13	1,236,898.78	
	TENARIS SA	40,648	10.72	435,949.80	
	TOTALENERGIES SE	199,789	51.26	10,241,184.14	
	AIR LIQUIDE	36,913	155.80	5,751,045.40	
	AKZO NOBEL	15,301	95.62	1,463,081.62	
	ARCELORMITTAL	55,231	31.62	1,746,404.22	
	ARKEMA	4,369	133.30	582,387.70	
	BASF SE	74,374	67.80	5,042,557.20	

	COVESTRO AG	14,454	54.00	780,516.00	
	CRH PLC	59,653	45.97	2,742,248.41	
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	29.32	579,187.28	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	39.48	227,483.76	
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	64.70	843,752.70	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	179.00	2,453,553.00	
	LANXESS	7,293	56.32	410,741.76	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	47.51	926,635.04	
	SOLVAY SA	5,356	109.50	586,482.00	
	STORA ENSO OYJ R	42,169	17.07	720,035.67	
	SYMRISE AG	9,776	114.65	1,120,818.40	
	UMICORE	17,605	34.18	601,738.90	
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	35.17	1,488,535.08	
	VOESTALPINE AG	7,152	33.72	241,165.44	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,729	22.84	473,450.36	
	ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	20,729	0.44	9,278.30	
	AIRBUS SE	45,872	115.12	5,280,784.64	
	ALSTOM	24,388	33.54	817,973.52	
	BOUYGUES ORD	16,606	32.60	541,355.60	
	BRENNTAG SE	12,514	78.18	978,344.52	
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	14.23	1,152,999.98	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,388	32.80	1,095,293.34	
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	103.20	219,816.00	
	EIFFAGE	5,924	94.72	561,121.28	
	FERROVIAL SA	41,914	26.03	1,091,021.42	
	GEA GROUP AG	13,382	43.41	580,912.62	
	IMCD NV	4,641	160.45	744,648.45	
	KINGSPAN GROUP PLC	12,398	88.38	1,095,735.24	
	KION GROUP AG	5,887	88.26	519,586.62	
	KNORR-BREMSE AG	6,822	91.32	622,985.04	
	KONE OYJ-B	26,311	59.66	1,569,714.26	
	LEGRAND SA	21,768	95.40	2,076,667.20	
	MTU AERO ENGINES AG	4,753	198.05	941,331.65	
	PRYSMIAN SPA	21,155	31.85	673,786.75	
	RATIONAL AG	483	785.20	379,251.60	
	SAFRAN SA	26,190	112.18	2,937,994.20	

	SAINT-GOBAIN	40,093	65.37	2,620,879.41	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,968	159.52	6,854,255.36	
	SIEMENS	61,210	144.34	8,835,051.40	
	SIEMENS ENERGY AG	26,851	22.40	601,462.40	
	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	18.39	412,579.65	
	THALES SA	9,665	83.40	806,061.00	
	VINCI S.A.	41,084	98.19	4,034,037.96	
	WARTSILA OYJ	41,917	12.73	533,603.41	
	BUREAU VERITAS SA	25,073	26.41	662,177.93	
	RANDSTAD NV	7,558	60.90	460,282.20	
	TELEPERFORMANCE	4,734	348.90	1,651,692.60	
	WOLTERS KLUWER	20,839	91.38	1,904,267.82	
	ADP	2,382	128.00	304,896.00	
	AENA SME SA	6,542	147.05	962,001.10	
	ATLANTIA SPA	35,937	17.06	613,264.90	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	6.82	158,715.04	
	DEUTSCHE POST AG-REG	78,714	53.81	4,235,600.34	
	GETLINK	29,362	14.25	418,555.31	
	INPOST SA	12,480	8.21	102,573.12	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,107	97.86	2,554,831.02	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	81.50	406,766.50	
	CONTINENTAL AG	8,168	94.02	767,955.36	
	DAIMLER AG	66,777	74.50	4,974,886.50	
	FAURECIA	10,948	43.09	471,749.32	
	FERRARI NV	10,170	210.80	2,143,836.00	
	MICHELIN	13,839	153.40	2,122,902.60	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	87.88	1,032,150.60	
	RENAULT SA	17,362	33.94	589,266.28	
	STELLANTIS NV	159,744	18.99	3,033,538.56	
	VALEO SA	21,538	26.97	580,879.86	
	VOLKSWAGEN AG-PFD	15,167	191.70	2,907,513.90	
	VOLKSWAGEN STAMM	2,486	267.00	663,762.00	
	ADIDAS AG	15,395	253.60	3,904,172.00	
	ESSILORLUXOTTICA	22,072	174.56	3,852,888.32	
	HERMES INTERNATIONAL	2,539	1,368.50	3,474,621.50	
	KERING	5,855	680.80	3,986,084.00	

	LVMH	21,933	697.70	15,302,654.10	
	MONCLER SPA	14,361	58.38	838,395.18	
	PUMA SE	9,220	94.36	869,999.20	
	SEB SA	2,282	130.60	298,029.20	
	ACCOR	14,436	31.58	455,888.88	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,048	134.00	1,748,432.00	
	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	36.39	295,050.12	
	SODEXO	8,135	84.20	684,967.00	
	BOLLORE	83,646	4.81	402,671.84	
	PUBLICIS GROUPE	17,077	60.70	1,036,573.90	
	SCOUT24 SE	7,492	58.14	435,584.88	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	52.00	367,692.00	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	21.73	1,330,810.39	
	VIVENDI SE	61,243	11.58	709,193.94	
	DELIVERY HERO SE	13,414	78.54	1,053,535.56	
	INDITEX	87,326	28.59	2,496,650.34	
	JUST EAT TAKEAWAY	15,572	47.13	733,908.36	
	PROSUS	75,024	73.00	5,476,752.00	
	ZALANDO SE	17,664	68.44	1,208,924.16	
	CARREFOUR	52,544	17.47	917,943.68	
	COLRUYT SA	5,424	36.79	199,548.96	
	HELLOFRESH SE	13,805	56.42	778,878.10	
	JERONIMO MARTINS	24,901	21.87	544,584.87	
	KESKO OYJ-B SHS	20,083	27.35	549,270.05	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	79,170	29.91	2,368,370.55	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,098	58.50	3,515,733.00	
	DANONE (GROUPE)	51,543	57.16	2,946,197.88	
	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	11.37	558,250.87	
	HEINEKEN HOLDING NV	9,251	81.90	757,656.90	
	HEINEKEN NV	20,157	99.82	2,012,071.74	
	JDE PEET'S BV	7,000	26.43	185,010.00	
	KERRY GROUP PLC-A	13,050	111.90	1,460,295.00	
	PERNOD-RICARD	16,970	198.65	3,371,090.50	
	REMY COINTREAU	1,382	191.70	264,929.40	
	BEIERSDORF AG	7,430	89.10	662,013.00	
	HENKEL AG & CO KGAA	8,780	74.65	655,427.00	

	HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	77.52	1,119,311.28	
	LOREAL	19,839	377.25	7,484,262.75	
	AMPLIFON SPA	11,650	39.74	462,971.00	
	BIOMERIEUX	3,044	102.35	311,553.40	
	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	141.95	486,888.50	
	DIASORIN SPA	2,070	145.15	300,460.50	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	14,472	59.82	865,715.04	
	FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	37.11	1,250,367.23	
	KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	30.00	2,153,008.77	
	ORPEA	4,336	86.18	373,676.48	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	455.90	831,561.60	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	59.44	1,281,942.48	
	ARGENX SE	3,428	252.00	863,856.00	
	BAYER	79,047	52.12	4,119,929.64	
	EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	92.60	946,372.00	
	GRIFOLS SA	27,685	16.81	465,523.27	
	IPSEN	3,532	84.16	297,253.12	
	MERCK KGAA	10,555	190.00	2,005,450.00	
	ORION OYJ-CLASS B	9,854	36.10	355,729.40	
	QIAGEN N.V.	17,038	43.56	742,175.28	
	RECORDATI SPA	9,859	51.20	504,780.80	
	SANOFI	90,684	91.73	8,318,443.32	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,939	374.30	725,767.70	
	UCB (GROUPE)	9,389	91.52	859,281.28	
	ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	14.55	581,169.91	
	BANCO BILBAO VIZCAYA	534,866	5.69	3,044,457.27	
	BANCO SANTANDER SA	1,404,532	3.13	4,402,505.55	
	BNP PARIBAS	89,478	65.40	5,851,861.20	
	CAIXABANK	380,168	2.77	1,055,726.53	
	COMMERZBANK AG	61,889	7.41	458,845.04	
	CREDIT AGRICOLE SA	89,515	13.54	1,212,033.10	
	ERSTE GROUP BANK AG	23,905	43.42	1,037,955.10	
	FINECOBANK SPA	53,120	15.22	808,486.40	
	ING GROEP NV-CVA	301,618	13.30	4,013,329.10	
	INTESA SANPAOLO	1,346,514	2.53	3,412,066.47	
	KBC GROEP NV	21,052	80.36	1,691,738.72	

	MEDIOBANCA	53,990	10.35	558,796.50	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	25.36	316,746.40	
	SOCIETE GENERALE	63,329	33.67	2,132,604.07	
	UNICREDIT SPA	168,352	13.57	2,284,873.34	
	AMUNDI SA	4,626	72.90	337,235.40	
	DEUTSCHE BANK NAMEN	160,613	11.78	1,892,663.59	
	DEUTSCHE BOERSE	14,999	158.15	2,372,091.85	
	EURAZEO SA	3,357	78.25	262,685.25	
	EURONEXT NV	6,480	86.20	558,576.00	
	EXOR NV	7,825	78.28	612,541.00	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	97.74	832,256.10	
	SOFINA	1,238	376.40	465,983.20	
	WENDEL	2,023	101.20	204,727.60	
	AEGON	114,647	4.98	571,744.58	
	AGEAS	11,086	43.76	485,123.36	
	ALLIANZ SE-REG	32,896	223.80	7,362,124.80	
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,637	18.72	1,603,124.64	
	AXA SA	155,519	28.00	4,355,309.59	
	CNP ASSURANCES	16,287	21.80	355,056.60	
	HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	173.40	751,342.20	
	MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,376	272.80	3,103,372.80	
	NN GROUP NV	22,611	51.04	1,154,065.44	
	POSTE ITALIANE SPA	46,035	11.59	533,545.65	
	SAMPO OYJ-A SHS	38,655	44.45	1,718,214.75	
	AROUNDTOWN SA	64,068	5.54	354,936.72	
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	115.80	610,845.00	
	VONOVIA SE	59,080	47.93	2,831,704.40	
	ADYEN NV	1,566	1,842.80	2,885,824.80	
	AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,584	62.46	2,222,576.64	
	BECHTLE AG	7,659	53.66	410,981.94	
	CAPGEMINI SA	12,715	205.40	2,611,661.00	
	DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	45.80	2,416,728.60	
	EDENRED	18,664	41.07	766,530.48	
	NEMETSCHEK SE	5,455	83.80	457,129.00	
	NEXI SPA	31,458	13.64	429,244.41	
	SAP SE	83,616	121.42	10,152,654.72	

	WORLDLINE SA	20,332	45.80	931,205.60	
	NOKIA OYJ	427,600	5.11	2,185,891.20	
	CELLNEX TELECOM SA	41,435	42.68	1,768,445.80	
	DEUTSCHE TELEKOM	269,906	16.19	4,371,937.38	
	ELISA A	10,227	53.60	548,167.20	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.60	291,721.50	
	KPN (KON.)	282,927	2.90	821,902.93	
	ORANGE	153,815	9.95	1,531,074.51	
	PROXIMUS	13,141	17.48	229,770.38	
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.41	349,887.34	
	TELEFONICA	417,939	4.02	1,683,249.32	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.58	255,573.13	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	34.48	328,008.24	
	E.ON SE	170,377	12.09	2,060,539.43	
	EDP RENOVAVEIS SA	21,466	19.21	412,361.86	
	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	8.29	327,629.09	
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	113.30	331,402.50	
	ENAGAS	15,690	19.89	312,074.10	
	ENDESA	25,972	19.58	508,531.76	
	ENEL	651,071	6.81	4,434,444.58	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.51	1,019,274.79	
	ENGIE	141,564	13.50	1,911,680.25	
	FORTUM OYJ	32,550	25.43	827,746.50	
	IBERDROLA SA	459,476	9.99	4,592,922.09	
	IBERDROLA SA-RTS	459,476	0.16	76,273.01	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	29.06	290,890.60	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.80	705,449.60	
	RWE STAMM	49,680	35.77	1,777,053.60	
	SNAM SPA	147,559	5.08	749,894.83	
	SUEZ	32,549	19.83	645,446.67	
	TERNA SPA	102,810	6.81	700,547.34	
	UNIPER SE	7,335	40.51	297,140.85	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	51,027	32.28	1,647,151.56	
	VERBUND AG	6,430	91.10	585,773.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,483	348.10	1,212,432.30	
	ASML HOLDING NV	32,819	626.20	20,551,257.80	

	INFINEON TECHNOLOGIES	105,296	38.03	4,004,406.88	
	STMICROELECTRONICS	55,076	41.35	2,277,392.60	
ユーロ 小計		15,247,587		394,189,655.26 (51,150,049,666)	
イギリスポンド	BP PLC	1,615,015	3.94	6,364,774.11	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	327,167	18.69	6,116,059.89	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	295,308	18.71	5,526,393.91	
	ANGLO AMERICAN PLC	102,156	35.17	3,593,337.30	
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	14.82	531,565.20	
	BHP GROUP PLC	167,196	24.73	4,135,593.06	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	83.20	908,876.80	
	EVRAZ PLC	43,000	5.67	243,896.00	
	GLENCORE PLC	767,331	4.19	3,215,884.22	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	20.06	337,970.88	
	MONDI PLC	36,710	18.78	689,597.35	
	RIO TINTO PLC REG	87,100	56.54	4,924,634.00	
	ASHTEAD GROUP PLC	34,104	52.16	1,778,864.64	
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.98	1,556,462.33	
	BUNZL PLC	24,880	27.23	677,482.40	
	DCC PLC	9,127	63.06	575,548.62	
	FERGUSON PLC	17,761	119.05	2,114,447.05	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	319,777	1.62	520,596.95	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.23	783,058.34	
	SMITHS GROUP PLC	37,146	16.01	594,707.46	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	132.30	729,502.20	
	EXPERIAN PLC	74,115	30.61	2,268,660.15	
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	53.64	745,059.60	
	RELX PLC	149,517	22.60	3,379,084.20	
	RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.16	724,876.80	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	6.74	493,967.09	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7,688	44.53	342,346.64	
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	18.66	555,769.04	
	PERSIMMON PLC	25,686	25.62	658,075.32	
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.60	424,151.02	
	COMPASS GROUP PLC	142,427	17.09	2,434,789.56	
	ENTAIN PLC	49,630	17.09	848,424.85	

	INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	48.59	779,432.19	
	WHITBREAD PLC	17,434	30.72	535,572.48	
	AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.88	498,973.33	
	INFORMA PLC	110,598	5.69	629,302.62	
	PEARSON	66,305	6.60	437,613.00	
	WPP PLC	95,821	12.06	1,155,601.26	
	JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.91	396,690.35	
	KINGFISHER PLC	153,717	3.37	518,487.44	
	NEXT PLC	11,468	75.40	864,687.20	
	OCADO GROUP PLC	35,862	14.55	521,971.41	
	SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.91	432,099.85	
	TESCO PLC	601,050	2.87	1,730,122.42	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	21.31	548,519.40	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	173,638	31.35	5,444,419.49	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.36	473,425.60	
	DIAGEO	186,926	37.09	6,934,019.97	
	IMPERIAL BRANDS PLC	68,756	17.44	1,199,448.42	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	57,728	63.66	3,674,964.48	
	UNILEVER PLC	204,424	36.75	7,513,604.12	
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	12.63	866,354.85	
	ASTRAZENECA	122,229	87.33	10,674,258.57	
	GLAXOSMITHKLINE	401,546	16.66	6,691,362.54	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	20.20	332,370.80	
	BARCLAYS	1,339,545	2.06	2,772,188.37	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,632,150	5.12	8,364,768.75	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,443,807	0.53	2,933,123.21	
	NATWEST GROUP PLC	443,701	2.49	1,107,477.69	
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	5.14	1,092,397.33	
	3I GROUP PLC	74,757	14.10	1,054,073.70	
	ABRDN PLC	153,430	2.38	365,623.69	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	13.47	445,574.13	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	24,732	74.40	1,840,060.80	
	M&G PLC	229,107	2.15	494,412.90	
	SCHRODERS PLC	11,794	34.19	403,236.86	
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	16.25	665,382.17	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	32.66	530,888.30	

	AVIVA PIC	296,550	4.41	1,307,785.50	
	LEGAL & GENERAL GROUP	460,759	2.99	1,380,894.72	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.98	356,292.98	
	PRUDENTIAL	210,968	12.86	2,714,103.32	
	AVEVA GROUP PLC	10,917	29.74	324,671.58	
	SAGE GROUP PLC	76,660	8.00	613,739.96	
	HALMA PLC	31,069	25.67	797,541.23	
	BT GROUP PLC	648,635	1.89	1,231,757.86	
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	1.20	2,664,656.01	
	NATIONAL GRID PLC	286,046	10.89	3,115,040.94	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	29.15	654,942.20	
	SSE PLC	81,663	15.67	1,280,067.52	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.70	626,806.00	
イギリスポンド 小計		22,795,161		150,785,266.49 (23,483,297,403)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	20.04	348,655.92	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	976.00	560,224.00	
	GIVAUDAN-REG	748	4,201.00	3,142,348.00	
	HOLCIM LTD	40,627	50.80	2,063,851.60	
	SIKA AG-BR	10,926	331.90	3,626,339.40	
	ABB LTD	127,656	34.00	4,340,304.00	
	GEBERIT AG-REG	2,964	647.80	1,920,079.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,375	230.80	317,350.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	233.80	722,909.60	
	VAT GROUP AG	1,956	383.20	749,539.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	10,450	50.38	526,471.00	
	SGS SA	506	2,837.00	1,435,522.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	264.00	1,208,328.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	41,341	141.00	5,829,081.00	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	297.00	737,451.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	56.60	222,890.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,228.00	623,840.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	106,200.00	849,600.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,540.00	864,280.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	222,591	120.16	26,746,534.56	
	ALCON INC	39,333	72.20	2,839,842.60	

	SONOVA HOLDING AG-REG	4,007	326.70	1,309,086.90	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,592.00	1,359,568.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	370	550.00	203,500.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,895	654.20	3,856,509.00	
	NOVARTIS	172,649	81.46	14,063,987.54	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	393.40	1,101,126.60	
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,594	365.70	20,330,725.80	
	VIFOR PHARMA AG	4,486	162.00	726,732.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.06	1,933,740.95	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	63.30	1,196,180.10	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	1,328.50	2,435,140.50	
	UBS GROUP AG	284,265	17.66	5,020,119.90	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	158.60	691,813.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	594.40	1,437,853.60	
	SWISS RE LTD	24,674	97.48	2,405,221.52	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,660	439.60	5,125,736.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	87.40	496,344.60	
	TEMENOS AG - REG	5,150	113.70	585,555.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	72.86	1,070,021.96	
	SWISSCOM	2,187	518.40	1,133,740.80	
スイスフラン 小計		1,368,714		126,158,145.85 (15,753,367,672)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	367.90	6,335,973.80	
	BOLIDEN AB	23,903	397.80	9,508,613.40	
	SCA SV CELLULOSA B	43,887	160.00	7,021,920.00	
	ALFA LAVAL AB	27,268	324.10	8,837,558.80	
	ASSA ABLOY AB-B	78,158	258.20	20,180,395.60	
	ATLAS COPCO A	51,320	576.00	29,560,320.00	
	ATLAS COPCO B	31,902	494.00	15,759,588.00	
	EPIROC AB-A	46,999	218.30	10,259,881.70	
	EPIROC AB-B	37,972	183.40	6,964,064.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	129.75	5,022,882.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	295.00	4,130,590.00	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	216.00	3,881,520.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	95.38	10,265,177.12	
	SANDVIK AB	87,644	246.60	21,613,010.40	

	SKANSKA B	25,507	233.50	5,955,884.50	
	SKF AB-B	24,865	222.20	5,525,003.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	220.60	2,981,188.40	
	VOLVO B	111,799	218.20	24,394,541.80	
	SECURITAS B	29,533	116.90	3,452,407.70	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	206.20	4,385,667.80	
	EVOLUTION AB	14,096	1,211.60	17,078,713.60	
	EMBRACER GROUP AB	37,510	88.50	3,319,635.00	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	174.76	9,651,820.04	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	72.78	9,262,710.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	273.60	13,536,086.40	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	331.70	5,902,933.20	
	NORDEA BANK ABP	253,851	109.40	27,771,299.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	120,740	123.65	14,929,501.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	110,736	103.15	11,422,418.40	
	SWEDBANK AB-A	72,526	184.00	13,344,784.00	
	EQT AB	23,207	408.00	9,468,456.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	287.80	3,401,220.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	281.70	3,146,025.60	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	213.70	8,318,272.50	
	INVESTOR AB-B SHS	142,777	205.30	29,312,118.10	
	KINNEVIK AB - B	18,792	280.80	5,276,793.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	477.80	3,478,384.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	559.00	5,282,550.00	
	SAGAX AB-B	12,402	257.40	3,192,274.80	
	SINCH AB	44,150	94.18	4,158,047.00	
	ERICSSON (LM) B	225,508	103.58	23,358,118.64	
	HEXAGON AB-B SHS	153,838	125.90	19,368,204.20	
	TELE2 AB-B SHS	32,829	130.90	4,297,316.10	
	TELIA CO AB	230,643	36.88	8,506,113.84	
スウェーデンクローナ 小計		2,673,085		462,819,985.24 (5,813,019,014)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	6,114	307.00	1,876,998.00	
	EQUINOR ASA	76,370	249.70	19,069,589.00	
	NORSK HYDRO	96,800	72.62	7,029,616.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	471.70	5,895,306.60	

	ADEVINTA ASA	19,117	104.45	1,996,770.65	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	272.00	2,522,528.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	302.00	2,138,764.00	
	MOWI ASA	31,968	207.30	6,626,966.40	
	ORKLA	69,804	86.18	6,015,708.72	
	DNB BANK ASA	71,795	214.00	15,364,130.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	221.80	4,119,713.20	
	TELENOR ASA	51,193	143.60	7,351,314.80	
ノルウェークローネ 小計		470,589		80,007,405.37 (1,042,496,491)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	551.80	4,680,919.40	
	NOVOZYMES A/S	17,111	469.10	8,026,770.10	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	2,514.00	1,898,070.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	81,654	182.60	14,910,020.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	20,860.00	4,568,340.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	22,320.00	9,686,880.00	
	DSV A/S	16,380	1,369.50	22,432,410.00	
	PANDORA A/S	8,163	786.80	6,422,648.40	
	CARLSBERG AS-B	8,646	1,109.00	9,588,414.00	
	AMBU A/S-B	13,555	140.30	1,901,766.50	
	COLOPLAST-B	9,208	991.00	9,125,128.00	
	DEMANT A/S	8,512	301.70	2,568,070.40	
	GN STORE NORD A/S	9,226	389.00	3,588,914.00	
	GENMAB A/S	5,250	2,293.00	12,038,250.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	132,369	641.90	84,967,661.10	
	DANSKE BANK A/S	56,132	128.80	7,229,801.60	
	TRYG A/S	29,772	165.75	4,934,709.00	
	ORSTED A/S	15,439	734.00	11,332,226.00	
デンマーククローネ 小計		421,308		219,900,998.90 (3,832,874,410)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	31.14	642,387.06	
	SANTOS	273,225	7.20	1,967,220.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	28.52	365,426.76	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	25.42	1,891,349.68	
	BHP GROUP LTD	234,548	46.56	10,920,554.88	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	19.88	691,227.60	

	EVOLUTION MINING LTD	122,154	3.81	465,406.74	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,483	20.44	2,830,592.52	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	49.85	1,841,857.80	
	NEWCREST MINING LIMITED	61,178	23.97	1,466,436.66	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	8.75	889,245.00	
	ORICA LTD	38,288	13.92	532,968.96	
	RIO TINTO LTD	28,818	109.91	3,167,386.38	
	SOUTH32 LTD	341,133	4.10	1,398,645.30	
	REECE LTD	16,814	23.24	390,757.36	
	BRAMBLES LTD	108,007	10.41	1,124,352.87	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.65	436,507.15	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.09	432,650.00	
	TRANSURBAN GROUP	233,493	13.02	3,040,078.86	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	43.35	2,003,203.50	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	12.55	380,616.40	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	105.64	374,071.24	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	31.62	562,614.66	
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	5.16	939,187.08	
	REA GROUP LTD	3,586	153.84	551,670.24	
	SEEK LTD	28,001	30.29	848,150.29	
	WESFARMERS LTD	87,120	54.61	4,757,623.20	
	COLES GROUP LTD	108,486	16.46	1,785,679.56	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.41	704,465.41	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	35.40	3,536,495.40	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	11.58	816,830.04	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	195.58	935,459.14	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	65.73	1,067,981.04	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	39.89	1,485,942.39	
	CSL LIMITED	35,618	270.40	9,631,107.20	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	225,511	28.56	6,440,594.16	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	141,979	99.33	14,102,774.07	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	262,008	29.07	7,616,572.56	
	WESTPAC BANKING	283,793	21.24	6,027,763.32	
	ASX LTD	14,549	89.77	1,306,063.73	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,074	199.19	5,392,870.06	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	19.80	216,057.60	

	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	4.45	1,020,861.15	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.39	787,100.37	
	QBE INSURANCE GROUP	111,591	12.08	1,348,019.28	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	11.69	1,108,960.16	
	AFTERPAY LTD	16,621	66.47	1,104,797.87	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	20.94	929,233.44	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	52.00	717,652.00	
	XERO LTD	11,340	117.72	1,334,944.80	
	TELSTRA CORP	308,467	4.19	1,292,476.73	
	AUSNET SERVICES	187,145	2.52	471,605.40	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	5.78	957,139.10	
オーストラリアドル 小計		5,344,458		117,051,634.17 (9,677,829,113)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.50	884,032.50	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	30.40	1,215,392.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	11.50	417,645.50	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.52	783,358.95	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.07	392,200.91	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	4.61	509,607.84	
ニュージーランドドル 小計		542,443		4,202,237.70 (325,631,399)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	55.35	12,702,603.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	133.20	14,252,400.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	20.35	3,500,200.00	
	MTR CORP	125,000	42.75	5,343,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	31.00	3,720,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	44.50	7,743,000.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	20.50	4,059,000.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	13.30	2,290,260.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	19.54	2,850,886.00	
	WH GROUP LTD	809,301	4.96	4,014,132.96	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	29.40	8,276,100.00	
	HANG SENG BANK	59,400	154.80	9,195,120.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,800	456.40	43,723,120.00	
	AIA GROUP LTD	968,400	83.85	81,200,340.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	53.05	8,726,512.80	

	ESR CAYMAN LTD	157,000	25.90	4,066,300.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	16.30	2,819,900.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	33.70	4,220,183.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	30.55	4,166,256.25	
	SINO LAND CO	315,400	9.80	3,090,920.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	94.70	10,227,600.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	46.20	1,871,100.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	20.50	1,972,100.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	119,000	39.25	4,670,750.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	49.00	3,307,500.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	77.60	10,670,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	12.06	10,910,163.42	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	48.70	5,454,400.00	
香港ドル 小計		6,314,853		279,044,598.63 (4,093,584,261)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.32	730,436.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.71	546,854.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.07	549,243.24	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.78	479,700.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.29	766,194.00	
	DBS GROUP	141,500	35.93	5,084,095.00	
	OCBC BANK	257,100	12.23	3,144,333.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	29.89	2,806,671.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	9.57	749,331.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.68	822,480.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	7.10	303,880.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.20	342,000.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.21	467,997.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	584,543	2.47	1,443,821.21	
シンガポールドル 小計		2,681,475		18,237,035.45 (1,547,959,568)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	32.80	2,222,396.80	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	559.30	1,200,257.80	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	34.75	3,416,272.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	34.69	3,776,492.16	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	21.92	2,181,040.00	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	125.30	1,566,625.90	
	AZRIELI GROUP	4,323	302.10	1,305,978.30	
	NICE LTD	4,991	808.00	4,032,728.00	
イスラエルシェケル 小計		398,393		19,701,791.46 (719,174,493)	
合　計		86,564,579		496,932,605,771 (496,932,605,771)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	82,693	825,276.14	
		LENDLEASE GROUP	64,786	680,900.86	
		SYDNEY AIRPORT	110,617	956,837.05	
	オーストラリアドル 小計		258,096	2,463,014.05 (203,642,001)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,708,875.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,967,500.00	
	香港ドル 小計		595,500	5,676,375.00 (83,272,421)	
投資信託受益証券合計			853,596	286,914,422 (286,914,422)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	696,675.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,263,756.14	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,371	9,056,379.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	95,067	740,571.93	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,787,332.04	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	1,351,530.36	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	1,259,212.50	
		CROWN CASTLE INTL CORP	34,399	6,301,552.81	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,174	3,435,417.82	
		DUKE REALTY CORP	31,540	1,834,366.40	
		EQUINIX INC	7,120	5,201,088.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	1,102,119.80	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,400	2,623,068.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST	4,770	1,619,224.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	2,156,319.88	

		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,615,960.50	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	985,011.55	
		INVITATION HOMES INC	46,840	2,007,094.00	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,008,616.24	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,167,339.88	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	2,008,563.48	
		PROLOGIS INC	59,030	9,066,417.70	
		PUBLIC STORAGE	12,441	4,441,934.64	
		REALTY INCOME CORP	41,563	2,849,974.91	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	912,302.12	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,757,117.09	
		SIMON PROPERTY GROUP	25,518	3,791,719.62	
		SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,758,428.70	
		UDR INC	24,265	1,394,266.90	
		VENTAS INC	31,565	1,602,555.05	
		VICI PROPERTIES INC	43,921	1,221,003.80	
		VORNADO REALTY TRUST	11,390	502,412.90	
		WELLTOWER INC	32,739	2,800,166.67	
		WP CAREY INC	14,258	1,105,850.48	
	アメリカドル 小計		932,062	85,425,351.51 (9,764,971,931)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	275,675.67	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	351,313.20	
	カナダドル 小計		20,377	626,988.87 (57,325,592)	
	ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	381,379.32	
		GECINA SA	3,139	382,487.15	
		KLEPIERRE	17,225	407,371.25	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	696,616.65	
	ユーロ 小計		35,781	1,867,854.37 (242,372,783)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	439,000.59	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	534,507.54	
		SEGRO PLC	93,383	1,232,655.60	
	イギリスポンド 小計		239,146	2,206,163.73 (343,587,939)	

	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	1,032,167.30	
		GOODMAN GROUP	124,848	2,861,516.16	
		GPT GROUP	167,884	903,215.92	
		MIRVAC GROUP	266,683	762,713.38	
		SCENTRE GROUP	382,183	1,161,836.32	
		STOCKLAND	207,412	869,056.28	
		VICINITY CENTERS	365,149	620,753.30	
	オーストラリアドル 小計		1,608,249	8,211,258.66 (678,906,866)	
	香港ドル	LINK REIT	170,500	11,423,500.00	
	香港ドル 小計		170,500	11,423,500.00 (167,582,745)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	815,476.06	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340,429	684,262.29	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	407,000.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	504,076.42	
	シンガポールドル 小計		1,127,756	2,410,814.77 (204,629,957)	
投資証券合計			4,133,871	11,459,377,813 (11,459,377,813)	
合計				11,746,292,235 (11,746,292,235)	

(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 607銘柄	97.4%	—	—	70.9%
	投資証券 34銘柄	—	—	2.6%	1.9%
カナダドル	株式 87銘柄	99.7%	—	—	3.7%
	投資証券 2銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式 230銘柄	99.5%	—	—	10.1%
	投資証券 4銘柄	—	—	0.5%	0.0%

イギリスポンド	株式　81銘柄	98.6%	—	—	4.6%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.4%	0.1%
スイスフラン	株式　41銘柄	100.0%	—	—	3.1%
スウェーデンクローナ	株式　44銘柄	100.0%	—	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　18銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オーストラリアドル	株式　53銘柄	91.6%	—	—	1.9%
	投資信託受益証券　3銘柄	—	1.9%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　6銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　28銘柄	94.2%	—	—	0.8%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.9%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式　14銘柄	88.3%	—	—	0.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	11.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月 20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	846,392,872
コール・ローン	786,610,655
国債証券	79,826,672,000
未収利息	1,076,235,045
前払費用	171,782,130
流動資産合計	82,707,692,702
資産合計	82,707,692,702
負債の部	

流動負債	
未払解約金	17,220,350
未払利息	1,179
流動負債合計	17,221,529
負債合計	17,221,529
純資産の部	
元本等	
元本	47,259,879,384
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	35,430,591,789
元本等合計	82,690,471,173
純資産合計	82,690,471,173
負債純資産合計	82,707,692,702

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月 20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 1月 20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	47,259,879,384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 1.7497円 (1万口当たり純資産額) (17,497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 1月 20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商

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

２．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月 20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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 1月 20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月 21日
期首元本額	36,785,091,133円
期中追加設定元本額	12,016,409,255円
期中一部解約元本額	1,541,621,004円
期末元本額	47,259,879,384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	5,093,843,939円
世界経済インデックスファンド	10,932,053,540円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	5,032,396,590円

ＤＣ世界経済インデックスファンド	10,348,937,998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）	1,801,706,652円
コア投資戦略ファンド（安定型）	146,670,330円
コア投資戦略ファンド（成長型）	399,809,303円
新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	73,041,406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）	423,802,219円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,295,753,185円
コア投資戦略ファンド（切替型）	148,300,289円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	203,205,510円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	91,898,611円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	165,124,941円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,976,730,415円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	293,001,606円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	350,859,247円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	585,842,487円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	7,246,843円
グローバル経済コア	728,627,109円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	43,103,997円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	5,601,256円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	10,928,104円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	6,945,937円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	3,436,102円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	3,565,594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）	78,614,789円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	410,132,566円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	77,767,247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）	16,254,903円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	300,810,171円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０５（適格機関投資家専用）	311,357,275円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	302,274,976円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	300,458,970円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	289,902,869円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	285,373,626円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 1月 20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△1,414,918,599
合計	△1,414,918,599

(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	37,876,026.00	
		MBONO 10% 12/05/24	100,250,000.00	106,711,112.50	
		MBONO 5.75% 03/05/26	172,100,000.00	161,082,158.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	88,100,000.00	88,022,472.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	159,500,000.00	158,676,980.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	115,600,000.00	115,891,312.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	108,500,000.00	105,482,615.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	33,800,000.00	33,758,764.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	136,900,000.00	143,376,739.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	82,000,000.00	85,803,160.00	
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	129,985,740.00	
		MBONO 8% 11/07/47	85,100,000.00	84,595,357.00	
		MBONO 8% 12/07/23	105,950,000.00	107,194,912.50	
	メキシコペソ 小計		1,348,000,000.00	1,358,457,348.00 (7,573,943,098)	
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000.00	74,237,656.28	
		BLTN 0% 07/01/23	70,000,000.00	59,448,542.99	
		BLTN 0% 07/01/24	41,850,000.00	32,123,461.54	
		BNTNF 10% 01/01/23	56,600,000.00	55,646,462.23	
		BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	30,820,179.76	
		BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000.00	39,352,791.52	
		BNTNF 10% 01/01/29	23,100,000.00	21,620,619.24	
		BNTNF 10% 01/01/31	16,850,000.00	15,620,931.38	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,362,375.00	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,828,750.00	
	ブラジルレアル 小計		376,800,000.00	332,061,769.94 (6,968,083,798)	
	チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	715,000,000.00	568,886,518.20	
		BTPCL 2.5% 03/01/25	2,685,000,000.00	2,421,742,371.21	
		BTPCL 4.5% 03/01/26	1,820,000,000.00	1,721,149,317.16	
		BTPCL 4.7% 09/01/30	1,940,000,000.00	1,766,144,641.84	
		BTPCL 4% 03/01/23	840,000,000.00	821,207,473.80	
		BTPCL 5% 03/01/35	2,040,000,000.00	1,824,708,461.28	

		BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	622,059,583.86	
		BTPCL 6% 01/01/43	1,520,000,000.00	1,473,179,002.24	
	チリペソ 小計		12,220,000,000.00	11,219,077,369.59 (1,583,483,018)	
	コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	62,800,000,000.00	69,132,752,000.00	
		COLTES 6.25% 11/26/25	6,300,000,000.00	5,946,822,000.00	
		COLTES 7.25% 10/18/34	32,500,000,000.00	27,452,750,000.00	
		COLTES 7.25% 10/26/50	8,900,000,000.00	6,898,212,000.00	
	コロンビアペソ 小計		110,500,000,000.00	109,430,536,000.00 (3,128,400,163)	
	ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,763,305.00	
		PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	5,708,269.00	
		PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,801,417.00	
		PERUGB 5.94% 02/12/29	7,400,000.00	7,479,772.00	
		PERUGB 6.15% 08/12/32	6,300,000.00	6,240,024.00	
		PERUGB 6.35% 08/12/28	7,700,000.00	8,000,223.00	
		PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	6,947,289.50	
		PERUGB 6.95% 08/12/31	8,550,000.00	9,028,885.50	
		PERUGB 8.2% 08/12/26	6,050,000.00	6,826,578.00	
	ペルーヌエボソル 小計		57,500,000.00	57,795,763.00 (1,709,500,416)	
	ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	24,167,250.00	
		URUGUA 8.5% 03/15/28	12,500,000.00	12,367,875.00	
	ウルグアイペソ 小計		37,500,000.00	36,535,125.00 (93,672,406)	
	ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	20,991,396.00	
		DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	36,223,440.00	
	ドミニカペソ 小計		53,400,000.00	57,214,836.00 (113,148,059)	
	トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,220,237.50	
		TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	5,522,765.50	
		TURKGB 10.6% 02/11/26	11,050,000.00	7,924,507.50	
		TURKGB 10.7% 08/17/22	8,650,000.00	8,236,270.50	
		TURKGB 11.7% 11/13/30	16,600,000.00	10,098,942.00	
		TURKGB 11% 02/24/27	7,400,000.00	4,902,130.00	
		TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,164,826.00	

		TURKGB 12.4% 03/08/28	4,700,000.00	3,165,638.00	
		TURKGB 12.6% 10/01/25	17,400,000.00	13,526,760.00	
		TURKGB 16.2% 06/14/23	7,100,000.00	6,636,938.00	
		TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,326,234.00	
		TURKGB 8.5% 09/14/22	5,100,000.00	4,763,094.00	
		TURKGB 8% 03/12/25	12,400,000.00	8,658,176.00	
		TURKGB 9% 07/24/24	17,900,000.00	13,690,457.00	
	トルコリラ 小計		137,000,000.00	104,836,976.00 (891,586,062)	
	チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	31,100,000.00	24,194,867.00	
		CZGB 0.25% 02/10/27	53,700,000.00	45,873,225.00	
		CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	44,270,710.00	
		CZGB 0.95% 05/15/30	54,900,000.00	45,736,641.00	
		CZGB 0% 12/12/24	12,000,000.00	10,827,720.00	
		CZGB 1.2% 03/13/31	46,000,000.00	38,549,380.00	
		CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	54,507,960.00	
		CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	17,062,682.00	
		CZGB 1.75% 06/23/32	38,000,000.00	33,213,140.00	
		CZGB 1% 06/26/26	72,800,000.00	65,369,304.00	
		CZGB 2.4% 09/17/25	51,900,000.00	49,884,723.00	
		CZGB 2.5% 08/25/28	69,300,000.00	65,746,989.00	
		CZGB 2.75% 07/23/29	58,500,000.00	56,606,355.00	
		CZGB 2% 10/13/33	59,700,000.00	52,671,519.00	
		CZGB 4.2% 12/04/36	28,000,000.00	31,100,720.00	
		CZGB 4.7% 09/12/22	35,800,000.00	35,917,066.00	
		CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	39,244,946.00	
	チェココルナ 小計		777,600,000.00	710,777,947.00 (3,798,610,582)	
	ハンガリーフォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	539,749,155.00	
		HGB 1.5% 08/23/23	322,500,000.00	312,080,025.00	
		HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	449,857,940.00	
		HGB 1.75% 10/26/22	130,000,000.00	128,315,200.00	
		HGB 1% 11/26/25	475,000,000.00	417,838,500.00	
		HGB 2.25% 04/20/33	542,000,000.00	422,228,840.00	
		HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	524,847,000.00	
		HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	433,189,350.00	

		HGB 2% 05/23/29	633,000,000.00	529,561,470.00	
		HGB 3.25% 10/22/31	692,000,000.00	608,406,400.00	
		HGB 3% 04/25/41	174,000,000.00	130,038,900.00	
		HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	392,039,025.00	
		HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	485,919,150.00	
		HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	543,923,680.00	
		HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	295,180,200.00	
		HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	680,928,600.00	
		HGB 6.0% 11/24/23	471,000,000.00	487,508,550.00	
		HGB 6.75% 10/22/28	382,000,000.00	426,059,880.00	
	ハンガリーフォリント 小計		8,554,000,000.00	7,807,671,865.00 (2,847,840,505)	
	ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	14,000,000.00	11,834,620.00	
		POLGB 0.75% 04/25/25	20,050,000.00	18,433,970.00	
		POLGB 1.25% 10/25/30	18,300,000.00	14,696,181.00	
		POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	17,500,173.00	
		POLGB 2.5% 01/25/23	19,600,000.00	19,523,952.00	
		POLGB 2.5% 04/25/24	14,250,000.00	14,058,195.00	
		POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	22,864,393.00	
		POLGB 2.5% 07/25/27	14,400,000.00	13,388,976.00	
		POLGB 2.75% 04/25/28	17,600,000.00	16,462,336.00	
		POLGB 2.75% 10/25/29	22,600,000.00	20,766,010.00	
		POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	13,133,400.00	
		POLGB 4% 10/25/23	12,700,000.00	12,919,964.00	
		POLGB 5.75% 09/23/22	7,500,000.00	7,692,675.00	
	ポーランドズロチ 小計		216,300,000.00	203,274,845.00 (5,829,780,262)	
	ロシアルーブル	RFLB 4.5% 07/16/25	270,000,000.00	232,729,200.00	
		RFLB 5.7% 05/17/28	219,000,000.00	182,547,450.00	
		RFLB 6.1% 07/18/35	214,500,000.00	166,981,815.00	
		RFLB 6.5% 02/28/24	149,000,000.00	141,155,150.00	
		RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	139,134,800.00	
		RFLB 6.9% 07/23/31	245,000,000.00	211,297,800.00	
		RFLB 6% 10/06/27	217,500,000.00	187,013,025.00	
		RFLB 7.05% 01/19/28	200,500,000.00	180,544,235.00	
		RFLB 7.1% 10/16/24	165,100,000.00	156,767,403.00	

		RFLB 7.15% 11/12/25	210,400,000.00	196,787,120.00	
		RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	139,776,240.00	
		RFLB 7.4% 07/17/24	202,200,000.00	193,956,306.00	
		RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	162,346,132.00	
		RFLB 7.65% 04/10/30	221,500,000.00	202,738,950.00	
		RFLB 7.7% 03/16/39	150,500,000.00	134,429,610.00	
		RFLB 7.7% 03/23/33	185,000,000.00	167,930,050.00	
		RFLB 7.75% 09/16/26	141,500,000.00	133,645,335.00	
		RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	172,281,230.00	
		RFLB 7% 01/25/23	112,200,000.00	109,709,160.00	
		RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	103,546,624.00	
		RFLB 8.15% 02/03/27	170,000,000.00	162,921,200.00	
		RFLB 8.5% 09/17/31	116,650,000.00	112,389,942.00	
	ロシアルーブル 小計		3,962,350,000.00	3,590,628,777.00 (5,385,943,165)	
	ルーマニアレイ	ROMGB 3.25% 06/24/26	6,000,000.00	5,593,140.00	
		ROMGB 3.65% 07/28/25	15,000,000.00	14,437,050.00	
		ROMGB 3.65% 09/24/31	5,000,000.00	4,340,200.00	
		ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,754,200.00	
		ROMGB 4.15% 01/26/28	10,500,000.00	10,022,670.00	
		ROMGB 4.15% 10/24/30	5,400,000.00	4,953,528.00	
		ROMGB 4.25% 06/28/23	20,000,000.00	19,966,400.00	
		ROMGB 4.75% 02/24/25	1,400,000.00	1,399,832.00	
		ROMGB 4.75% 10/11/34	2,500,000.00	2,330,175.00	
		ROMGB 4% 10/25/23	13,800,000.00	13,692,084.00	
		ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,954,700.00	
	ルーマニアレイ 小計		95,600,000.00	92,443,979.00 (2,424,870,279)	
	マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	12,200,000.00	11,198,258.00	
		MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,226,168.50	
		MGS 3.48% 03/15/23	17,600,000.00	17,875,440.00	
		MGS 3.502% 05/31/27	10,950,000.00	11,035,629.00	
		MGS 3.733% 06/15/28	23,100,000.00	23,428,020.00	
		MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,946,127.00	
		MGS 3.757% 05/22/40	12,650,000.00	11,837,237.50	
		MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,261,809.00	

		MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,018,042.00	
		MGS 3.885% 08/15/29	29,800,000.00	30,348,916.00	
		MGS 3.899% 11/16/27	14,800,000.00	15,212,920.00	
		MGS 3.9% 11/30/26	9,750,000.00	10,022,025.00	
		MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	8,941,077.00	
		MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	26,798,200.00	
		MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000.00	20,130,635.00	
		MGS 4.065% 06/15/50	11,650,000.00	11,173,515.00	
		MGS 4.181% 07/15/24	7,600,000.00	7,832,940.00	
		MGS 4.254% 05/31/35	15,350,000.00	15,729,759.00	
		MGS 4.762% 04/07/37	7,350,000.00	7,941,381.00	
	マレーシアリンギット 小計		252,350,000.00	254,958,099.00 (6,959,336,270)	
	タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	90,407,690.00	
		THAIGB 0.95% 06/17/25	116,700,000.00	116,381,409.00	
		THAIGB 1.45% 12/17/24	160,000,000.00	162,683,200.00	
		THAIGB 1.585% 12/17/35	56,800,000.00	50,039,664.00	
		THAIGB 1.6% 06/17/35	44,100,000.00	39,482,289.00	
		THAIGB 1.6% 12/17/29	111,100,000.00	107,492,583.00	
		THAIGB 2.125% 12/17/26	110,600,000.00	114,125,928.00	
		THAIGB 2.4% 12/17/23	152,000,000.00	157,046,400.00	
		THAIGB 2.875% 06/17/46	78,500,000.00	76,404,050.00	
		THAIGB 2.875% 12/17/28	133,200,000.00	141,342,516.00	
		THAIGB 2% 06/17/42	65,600,000.00	56,070,288.00	
		THAIGB 2% 12/17/22	65,000,000.00	65,897,000.00	
		THAIGB 3.3% 06/17/38	128,700,000.00	137,474,766.00	
		THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	140,794,408.00	
		THAIGB 3.625% 06/16/23	99,000,000.00	103,214,430.00	
		THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000.00	197,962,245.00	
		THAIGB 3.775% 06/25/32	95,500,000.00	109,018,980.00	
		THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	116,117,072.00	
		THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000.00	126,893,290.00	
	タイバーツ 小計		2,022,900,000.00	2,108,848,208.00 (7,317,703,281)	
	フィリピンペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	14,859,900.00	
		PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	33,575,400.00	

	フィリピンペソ 小計		45,000,000.00	48,435,300.00 (107,473,087)	
	インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,167,924,000.00	
		INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,468,188,000.00	
		INDOGB 5.125% 04/15/27	19,500,000,000.00	19,442,280,000.00	
		INDOGB 5.5% 04/15/26	36,500,000,000.00	36,887,995,000.00	
		INDOGB 5.625% 05/15/23	60,300,000,000.00	61,989,606,000.00	
		INDOGB 6.125% 05/15/28	34,000,000,000.00	34,440,640,000.00	
		INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,647,276,000.00	
		INDOGB 6.375% 04/15/32	16,000,000,000.00	15,993,760,000.00	
		INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	62,546,875,000.00	
		INDOGB 6.5% 06/15/25	57,300,000,000.00	60,162,135,000.00	
		INDOGB 6.625% 05/15/33	31,000,000,000.00	30,969,930,000.00	
		INDOGB 7.125% 06/15/42	22,300,000,000.00	22,582,764,000.00	
		INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	35,600,380,000.00	
		INDOGB 7.5% 05/15/38	21,000,000,000.00	21,890,820,000.00	
		INDOGB 7.5% 06/15/35	33,200,000,000.00	34,911,792,000.00	
		INDOGB 7.5% 08/15/32	21,900,000,000.00	23,268,969,000.00	
		INDOGB 7% 05/15/27	40,800,000,000.00	43,410,792,000.00	
		INDOGB 7% 09/15/30	56,000,000,000.00	57,540,560,000.00	
		INDOGB 8.125% 05/15/24	45,600,000,000.00	49,413,528,000.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/29	31,700,000,000.00	35,215,213,000.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	35,342,202,000.00	
		INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,927,332,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/24	53,600,000,000.00	58,086,320,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	58,280,040,000.00	
		INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,913,388,000.00	
		INDOGB 8.375% 09/15/26	29,100,000,000.00	32,726,151,000.00	
		INDOGB 8.75% 05/15/31	34,700,000,000.00	39,938,312,000.00	
		INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,659,366,000.00	
		INDOGB 9% 03/15/29	19,700,000,000.00	22,690,066,000.00	
	インドネシアルピア 小計		931,800,000,000.00	992,114,604,000.00 (7,936,916,832)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	146,600,000.00	162,577,934.00	
		SAGB 6.25% 03/31/36	54,800,000.00	38,604,956.00	
		SAGB 6.5% 02/28/41	34,100,000.00	22,896,104.00	

		SAGB 7.75% 02/28/23	38,900,000.00	39,986,866.00	
		SAGB 7% 02/28/31	64,700,000.00	54,545,982.00	
		SAGB 8.25% 03/31/32	97,200,000.00	87,457,644.00	
		SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000.00	83,326,376.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	86,000,000.00	72,709,560.00	
		SAGB 8.75% 02/28/48	151,100,000.00	127,495,158.00	
		SAGB 8.875% 02/28/35	78,000,000.00	70,357,560.00	
		SAGB 8% 01/31/30	138,700,000.00	128,229,537.00	
		SAGB 9% 01/31/40	64,450,000.00	56,581,299.50	
	南アフリカランド 小計		1,052,250,000.00	944,768,976.50 (7,057,424,254)	
	香港・オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	20,000,000.00	19,744,000.00	
		CGB 2.36% 07/02/23	18,000,000.00	18,047,880.00	
		CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,046,110.00	
		CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,108,800.00	
		CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,848,356.00	
		CGB 2.85% 06/04/27	24,500,000.00	24,871,910.00	
		CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	17,105,504.00	
		CGB 2.89% 11/18/31	5,000,000.00	5,068,650.00	
		CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,081,120.00	
		CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,392,150.00	
		CGB 3.01% 05/13/28	15,000,000.00	15,307,950.00	
		CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,674,420.00	
		CGB 3.02% 10/22/25	14,300,000.00	14,609,023.00	
		CGB 3.03% 03/11/26	17,500,000.00	17,907,400.00	
		CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,594,800.00	
		CGB 3.13% 11/21/29	24,300,000.00	24,958,530.00	
		CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,589,230.00	
		CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,346,440.00	
		CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,762,080.00	
		CGB 3.25% 11/22/28	14,900,000.00	15,438,784.00	
		CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,867,460.00	
		CGB 3.28% 12/03/27	20,000,000.00	20,796,000.00	
		CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,756,640.00	
		CGB 3.29% 10/18/23	16,000,000.00	16,312,000.00	
		CGB 3.53% 10/18/51	2,200,000.00	2,298,054.00	

		CGB 3.72% 04/12/51	7,300,000.00	7,800,999.00	
		CGB 3.81% 09/14/50	22,700,000.00	24,580,241.00	
	香港・オフショア人民元 小計		439,400,000.00	449,914,531.00 (8,098,956,463)	
合計				79,826,672,000 (79,826,672,000)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	9.5%
ブラジルレアル	国債証券 10銘柄	100.0%	8.7%
チリペソ	国債証券 8銘柄	100.0%	2.0%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	3.9%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.1%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券 14銘柄	100.0%	1.1%
チェココルナ	国債証券 17銘柄	100.0%	4.8%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	3.6%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	7.3%
ロシアルーブル	国債証券 22銘柄	100.0%	6.7%
ルーマニアレイ	国債証券 11銘柄	100.0%	3.0%
マレーシアリンギット	国債証券 19銘柄	100.0%	8.7%
タイバーツ	国債証券 19銘柄	100.0%	9.2%
フィリピンペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアルピア	国債証券 29銘柄	100.0%	9.9%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	8.8%
香港・オフショア人民元	国債証券 27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。

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 1月 20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,146,283,330
コール・ローン	88,268,100
株式	98,138,356,943
投資信託受益証券	185,187,064
投資証券	88,719,771
派生商品評価勘定	134,227,946
未収入金	1,762,520
未収配当金	44,448,918
差入委託証拠金	1,113,128,793
流動資産合計	105,940,383,385
資産合計	105,940,383,385
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	997,537
前受金	133,466,641
未払金	9,315
未払解約金	11,280,457
未払利息	132
流動負債合計	145,754,082
負債合計	145,754,082
純資産の部	
元本等	
元本	28,827,989,077
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	76,966,640,226
元本等合計	105,794,629,303
純資産合計	105,794,629,303
負債純資産合計	105,940,383,385

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

		2022年 1月 20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	28,827,989,077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 3.6699円 (1万口当たり純資産額) (36,699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 1月 20日現在

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

2．金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月 20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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 1月 20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月 21日

期首元本額	25,006,661,411円
期中追加設定元本額	5,289,079,072円
期中一部解約元本額	1,467,751,406円
期末元本額	28,827,989,077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	7,628,838,159円
世界経済インデックスファンド	5,241,696,474円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	5,164,402,868円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	5,098,877,404円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	209,043,773円
分散投資コア戦略ファンドＡ	223,488,884円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,291,777,359円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	687,733,620円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	581,136,059円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	330,135,084円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	16,163,100円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	81,597,648円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	140,347,565円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	530,216,061円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	95,143,010円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	3,665,385円
グローバル経済コア	349,222,485円
ｉ－ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	39,066,374円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	10,287,212円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	7,070,824円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	3,671,554円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	3,981,149円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	887,612,285円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	155,056,948円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	37,168,626円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	10,589,167円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 1月 20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△2,051,426,286
投資信託受益証券	△19,268,655
投資証券	5,007,399
合計	△2,065,687,542

(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 1月 20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	7,155,086,990	－	7,288,553,631	133,466,641

合計	7,155,086,990	―	7,288,553,631	133,466,641

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2022年 1月 20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	66,531,800	―	66,299,104	△232,696
	アメリカドル	66,531,800	―	66,299,104	△232,696
	売建	77,724,000	―	77,727,536	△3,536
	アメリカドル	77,724,000	―	77,727,536	△3,536
合計		144,255,800	―	144,026,640	△236,232

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1　有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	655,305	8.29	5,436,410.28	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	44,089	85.26	3,759,028.14	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,590	210.00	2,223,900.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	134,073	7.43	996,966.82	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	4.71	581,285.90	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	29,910	38.81	1,160,807.10	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	8.87	150,169.10	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	72,204	28.81	2,080,197.24	

	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	27.64	541,688.72	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	21.70	581,950.60	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,938	76.35	606,066.30	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	19.59	759,563.07	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,585	68.40	655,614.00	
	51JOB INC-ADR	2,701	51.88	140,127.88	
	DIDI GLOBAL INC	34,321	5.01	171,948.21	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	44,721	29.88	1,336,263.48	
	LI AUTO INC - ADR	60,121	29.26	1,759,140.46	
	NIO INC - ADR	147,534	28.63	4,223,898.42	
	XPENG INC - ADR	43,999	43.80	1,927,156.20	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	19,163	34.80	666,872.40	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	156,180	1.73	270,191.40	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	3.59	147,398.22	
	TRIP.COM GROUP LTD	55,661	23.47	1,306,363.67	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	45,333	45.53	2,064,011.49	
	AUTOHOME INC-ADR	6,571	36.49	239,775.79	
	BAIDU INC - SPON ADR	30,081	154.48	4,646,912.88	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	18,268	37.72	689,068.96	
	HELLO GROUP INC -SPN ADR	15,529	9.22	143,177.38	
	IQIYI INC-ADR	28,984	4.84	140,282.56	
	JOYY INC	6,185	50.56	312,713.60	
	KANZHUN LTD	6,900	28.18	194,442.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	64,895	6.82	442,583.90	
	VK CO LTD	19,368	9.00	174,312.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	33.55	176,103.95	
	YANDEX NV-A	32,725	48.34	1,581,926.50	
	DADA NEXUS LTD-ADR	7,696	11.28	86,810.88	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	20.56	154,672.88	
	PINDUODUO INC-ADR	48,659	64.35	3,131,206.65	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	9.14	482,272.10	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,926	13.17	525,825.42	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	68,136	3.66	249,377.76	
	BEIGENE LTD-ADR	4,929	236.85	1,167,433.65	
	HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	29.73	215,334.39	
	I-MAB-SPONSORED ADR	2,944	32.75	96,416.00	

	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	3,311	40.35	133,598.85	
	ZAI LAB LTD-ADR	7,677	51.97	398,973.69	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	189,281	3.29	622,734.49	
	CREDICORP LTD	7,637	142.42	1,087,661.54	
	SBERBANK-SPONSORED ADR	285,355	12.78	3,646,836.90	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	61.06	857,526.64	
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	1.15	434,742.55	
	360 DIGITECH INC	8,061	20.41	164,525.01	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	31.03	62,711.63	
	KE HOLDINGS INC	35,590	22.71	808,248.90	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.92	50,349.60	
	AGORA INC-ADR	4,630	12.16	56,300.80	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	12,493	4.97	62,090.21	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	9,050	42.57	385,258.50	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	5,558	11.52	64,028.16	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	36,600	4.89	179,010.60	
	VNET GROUP INC-ADR	7,475	9.31	69,592.25	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	39,854	7.22	287,745.88	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	42.75	334,946.25	
アメリカドル 小計		3,423,328		58,104,550.80 (6,641,931,201)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,545,161	13.59	20,998,737.99	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	323,292	95.34	30,822,659.28	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	239.08	3,466,660.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	49.00	4,745,748.00	
	ALFA S.A.B.-A	313,500	14.82	4,646,070.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	61.31	2,299,125.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	407.63	9,499,817.15	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	281.48	12,295,046.40	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	152.50	6,509,462.50	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	288,490	42.07	12,136,774.30	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	66.09	2,075,226.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	567,680	71.16	40,396,108.80	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	123.05	6,210,948.75	
	BECLE SAB DE CV	48,100	51.11	2,458,391.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	207,440	166.34	34,505,569.60	

	GRUMA S.A.B.-B	25,960	252.18	6,546,592.80	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	63.57	11,557,026.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	30.52	5,548,536.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	282,600	141.08	39,869,208.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	26.32	6,645,800.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,658,740	19.99	73,138,212.60	
	TELESITES SAB DE CV	74,800	22.20	1,660,560.00	
メキシコペソ 小計		8,292,260		338,032,280.17 (1,884,665,174)	
ブラジルレアル	COSAN SA	118,300	21.97	2,599,051.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	375,100	34.25	12,847,175.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	544,440	31.49	17,144,415.60	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	13.23	1,000,188.00	
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	49.20	949,560.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	26.47	1,667,610.00	
	GERDAU SA-PREF	141,800	29.04	4,117,872.00	
	SUZANO SA	90,079	61.85	5,571,386.15	
	VALE SA	439,387	88.21	38,758,327.27	
	WEG SA	171,144	30.50	5,219,892.00	
	CCR SA	125,600	11.34	1,424,304.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	49.85	3,088,307.20	
	RUMO SA	159,700	16.73	2,671,781.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	28,600	28.50	815,100.00	
	AMERICANAS SA	39,740	33.20	1,319,368.00	
	LOJAS RENNER S.A.	115,947	24.85	2,881,282.95	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	6.31	1,927,705.00	
	VIA S/A	135,900	4.00	543,600.00	
	VIBRA ENERGIA SA	134,600	20.52	2,761,992.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	15.04	624,160.00	
	RAIA DROGASIL SA	122,500	20.54	2,516,150.00	
	AMBEV SA	534,900	14.54	7,777,446.00	
	BRF SA	52,500	23.71	1,244,775.00	
	JBS SA	110,000	36.61	4,027,100.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	20.87	2,093,427.96	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	100,500	10.92	1,097,460.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	54,400	63.74	3,467,456.00	

	REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,600	40.14	1,830,384.00	
	HYPERA SA	35,300	28.42	1,003,226.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	161,367	17.62	2,843,286.54	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	531,802	21.10	11,221,022.20	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	31.01	2,738,183.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	523,681	23.48	12,296,029.88	
	ITAUSA SA	528,325	9.62	5,082,486.50	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	715,509	12.26	8,772,140.34	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	20.68	1,426,920.00	
	TOTVS SA	57,900	25.30	1,464,870.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	48.69	2,546,487.00	
	TIM SA	96,100	12.99	1,248,339.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	32.35	1,196,950.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	33.04	1,110,144.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	113,867	12.96	1,475,716.32	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	35.69	1,238,443.00	
	ENGIE BRASIL SA	29,250	39.33	1,150,402.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	80,900	22.20	1,795,980.00	
ブラジルレアル 小計		7,496,798		190,597,902.41 (3,999,563,563)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,270.00	280,457,100.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,445.00	196,469,425.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	15,220	46,997.00	715,294,340.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,620.00	185,592,940.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,370.10	189,057,358.80	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	6,720.00	49,627,200.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	75.00	364,698,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,718	27,550.00	157,530,900.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	38.80	243,657,054.80	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	96.00	335,166,240.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	32.20	82,473,151.60	
チリペソ 小計		17,612,897		2,800,023,710.20 (395,200,946)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,990.00	1,462,047,210.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	42,200.00	1,239,667,200.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	36,180.00	2,227,421,700.00	

	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	27,250.00	567,345,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	25,100.00	1,267,826,100.00	
コロンビアペソ 小計		651,251		6,764,307,210.00 (193,378,014)	
ユーロ	OPAP SA	18,496	13.10	242,297.60	
	JUMBO SA	19,341	14.38	278,123.58	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.25	330,903.34	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	1.00	284,895.81	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	16.96	444,601.75	
	PUBLIC POWER CORP	20,834	8.94	186,255.96	
ユーロ 小計		631,321		1,767,078.04 (229,296,046)	
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	44,689	12.18	544,535.46	
イギリスポンド 小計		44,689		544,535.46 (84,805,952)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	186.80	2,167,440.40	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	29.34	3,425,591.70	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	23.22	2,311,922.52	
	KOC HOLDING AS	89,884	32.86	2,953,588.24	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	14.22	4,248,196.56	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	270.40	1,757,870.40	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	70.30	3,010,527.20	
	AKBANK T.A.S.	276,321	7.88	2,177,409.48	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	12.03	2,887,103.76	
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	8.35	1,444,650.20	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	18.86	2,698,696.26	
トルコリラ 小計		1,498,297		29,082,996.72 (247,336,345)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	970.50	7,242,841.50	
	MONETA MONEY BANK AS	62,031	92.30	5,725,461.30	
	CEZ AS	18,145	812.50	14,742,812.50	
チェココルナ 小計		87,639		27,711,115.30 (148,096,513)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	2,660.00	112,664,300.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	8,600.00	130,530,800.00	
	OTP BANK NYRT	25,606	17,980.00	460,395,880.00	

ハンガリーフォリント 小計		83,139		703,590,980.00 (256,634,106)	
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	80.86	2,483,453.18	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	200,051	5.69	1,138,290.19	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	150.05	1,970,456.60	
	LPP SA	124	17,500.00	2,170,000.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	187.74	1,258,608.96	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	32.56	1,175,350.88	
	ALLEGRO.EU SA	39,203	40.20	1,575,960.60	
	DINO POLSKA SA	5,945	342.50	2,036,162.50	
	BANK PEKAO SA	23,647	133.50	3,156,874.50	
	M BANK SA	1,423	463.00	658,849.00	
	PKO BANK POLSKI SA	93,312	47.39	4,422,055.68	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	367.30	1,327,789.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	36.10	2,239,788.40	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	8.46	470,866.68	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	7.72	490,189.12	
ポーランドズロチ 小計		635,165		26,574,695.79 (762,143,672)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	4.69	1,543,010.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	7.72	1,482,240.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,915,400	4.16	12,128,064.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	411,500	20.75	8,538,625.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	236,000	5.45	1,286,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,148,000	4.02	8,634,960.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	142,000	17.42	2,473,640.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	4.58	1,557,200.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	41.80	6,040,100.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	8.99	1,968,810.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	468,000	4.23	1,979,640.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	10.80	4,449,600.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	6.75	1,944,000.00	
	DONGYUE GROUP	147,000	10.40	1,528,800.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	26,200	113.00	2,960,600.00	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	101,000	14.14	1,428,140.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	13.66	1,133,780.00	

	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	5.56	922,960.00	
	MMG LIMITED	304,000	2.70	820,800.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	8.23	1,061,670.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	50,750	12.98	658,735.00	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONA	285,000	7.45	2,123,250.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	10.10	7,362,900.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	5.29	1,454,750.00	
	BOC AVIATION LTD	23,800	66.05	1,571,990.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.91	766,360.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	38.00	6,061,000.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	15.08	1,930,240.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	4.64	2,199,360.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	9.61	1,633,700.00	
	CITIC LTD	617,000	8.77	5,411,090.00	
	CRRC CORP LTD-H	409,000	3.56	1,456,040.00	
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	8.69	2,502,720.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	21.90	1,708,200.00	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	7.71	1,233,600.00	
	SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	12.70	692,150.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	15.88	3,363,384.00	
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	13.80	1,948,780.80	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	41.45	2,582,335.00	
	ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	5.71	663,502.00	
	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	5.86	2,256,533.64	
	AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.84	1,249,760.00	
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	5.05	1,252,400.00	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	15.22	2,519,625.34	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.97	874,720.00	
	COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	15.08	7,812,194.00	
	COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	6.64	1,665,139.36	
	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	8.37	1,305,720.00	
	SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	8.60	1,100,129.20	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.89	606,320.00	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.30	2,686,400.00	
	BYD CO LTD-H	88,500	258.00	22,833,000.00	
	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	6.98	1,856,680.00	

	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	44.40	2,592,960.00	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	630,000	18.92	11,919,600.00	
	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	24.80	8,748,200.00	
	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	8.12	2,909,753.28	
	MINTH GROUP LTD	64,000	36.60	2,342,400.00	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	12.64	1,365,120.00	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	121,000	112.70	13,636,700.00	
	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	4.17	1,826,460.00	
	HAIER SMART HOME CO LTD-H	244,600	31.55	7,717,130.00	
	LI NING CO LTD	237,500	75.10	17,836,250.00	
	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	84,800	150.70	12,779,360.00	
	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	11.82	827,400.00	
	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	96,000	2.36	226,560.00	
	HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	17.48	2,027,680.00	
	JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	15.78	899,460.00	
	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	68,400	15.04	1,028,736.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.83	1,203,500.00	
	CHINA LITERATURE LTD	51,600	50.25	2,592,900.00	
	KINGSOFT CORP LTD	92,000	36.40	3,348,800.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	52,300	83.75	4,380,125.00	
	NETEASE INC	214,130	160.90	34,453,517.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	626,300	455.80	285,467,540.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,652,688	124.20	205,263,849.60	
	CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	54,000	35.00	1,890,000.00	
	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,206,958	0.64	772,453.12	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	268,000	2.28	611,040.00	
	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	47,300	66.05	3,124,165.00	
	JD.COM INC - CL A	188,388	281.40	53,012,383.20	
	MEITUAN-CLASS B	444,200	214.40	95,236,480.00	
	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	7.63	869,820.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	61.40	4,175,200.00	
	SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	3.02	782,180.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	113.63	1,727,176.00	
	CHINA FEIHE LTD	346,000	10.82	3,743,720.00	
	CHINA MENGNIU DAIRY CO	329,000	46.30	15,232,700.00	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	148,000	56.55	8,369,400.00	

	DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	4.53	1,114,380.00	
	HUISHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
	NONGFU SPRING CO LTD-H	193,000	43.35	8,366,550.00	
	SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	36.00	7,020,000.00	
	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	15.94	3,634,320.00	
	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	68,000	67.05	4,559,400.00	
	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	7.51	600,800.00	
	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	7.73	4,328,800.00	
	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	31.30	1,502,400.00	
	HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	39.30	3,438,750.00	
	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	18.52	463,000.00	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	6.49	2,738,780.00	
	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	35,200	45.50	1,601,600.00	
	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	8.53	1,057,720.00	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	26.65	1,758,900.00	
	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	26.70	1,433,790.00	
	SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	10.18	2,483,920.00	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	15.62	2,005,608.00	
	SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	18.50	2,316,200.00	
	VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	20,500	27.45	562,725.00	
	3SBIO INC	119,000	6.50	773,500.00	
	AKESO INC	25,000	26.95	673,750.00	
	CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	161.20	1,612,000.00	
	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	14.20	1,420,000.00	
	CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	956,160	9.72	9,293,875.20	
	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	5.51	914,660.00	
	GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	30.35	4,006,200.00	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	95.50	487,050.00	
	HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	17.88	2,181,360.00	
	INNOVENT BIOLOGICS INC	139,000	41.10	5,712,900.00	
	PHARMARON BEIJING CO LTD-H	22,300	114.20	2,546,660.00	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	34.65	2,529,450.00	
	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	6.04	6,722,520.00	
	WUXI APPTEC CO LTD-H	42,288	122.30	5,171,822.40	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	390,000	86.85	33,871,500.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,825,000	2.91	8,220,750.00	

	BANK OF CHINA LTD-H	8,801,200	3.00	26,403,600.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	5.15	5,657,146.25	
	CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	366,500	2.19	802,635.00	
	CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.70	3,519,440.00	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,385,620	5.86	60,859,733.20	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.95	1,106,250.00	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	429,923	64.65	27,794,521.95	
	CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	3.18	2,144,592.00	
	IND&COMM BK OF CHINA-H	6,265,515	4.67	29,259,955.05	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	6.34	6,714,060.00	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.44	1,198,080.00	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.60	2,221,800.00	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	203,600	22.00	4,479,200.00	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	20.20	5,019,700.00	
	FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.92	1,660,800.00	
	GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	14.48	1,282,928.00	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	7.10	2,536,120.00	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	13.70	1,857,720.00	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	918,000	13.68	12,558,240.00	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	23.65	7,014,590.00	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	11.52	2,119,956.48	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	22.90	2,207,560.00	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.49	2,338,110.00	
	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	7.28	5,018,016.64	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	695,000	61.40	42,673,000.00	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	27.80	1,270,460.00	
	A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	41,500	14.36	595,940.00	
	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	4.00	568,000.00	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	2.80	1,618,400.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	415,540	23.35	9,702,859.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	8.85	708,000.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	367,111	38.00	13,950,218.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	67,600	37.85	2,558,660.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	21.10	3,764,240.00	
	CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	64,000	13.00	832,000.00	
	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	564,000	5.20	2,932,800.00	

	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,016,654	6.67	6,781,082.18	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	191,000	42.50	8,117,500.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	13.20	957,000.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	7.44	1,339,200.00	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	436,800	3.47	1,515,696.00	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	66,000	16.08	1,061,280.00	
	KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	4.54	692,350.00	
	LOGAN GROUP CO LTD	150,000	5.94	891,000.00	
	LONGFOR PROPERTIES	197,000	42.80	8,431,600.00	
	POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	178,000	4.33	770,740.00	
	SEAZEN GROUP LTD	204,000	5.53	1,128,120.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	5.60	742,000.00	
	SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	75,000	5.82	436,500.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	327,000	9.46	3,093,420.00	
	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	163,000	8.53	1,390,390.00	
	WHARF HOLDINGS	154,000	25.50	3,927,000.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	7.68	887,808.00	
	CHINA YOUZAN LTD	1,456,000	0.37	546,000.00	
	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	8.77	2,420,520.00	
	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	23.45	7,292,950.00	
	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	88,000	16.84	1,481,920.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	14.24	1,124,960.00	
	WEIMOB INC	149,000	6.82	1,016,180.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	32.00	2,288,000.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	25.25	1,527,625.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	38.70	2,592,900.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	14.02	967,380.00	
	LENOVO GROUP LTD	732,000	8.79	6,434,280.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	76,800	212.80	16,343,040.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,405,800	18.32	25,754,256.00	
	ZTE CORP-H	82,908	22.55	1,869,575.40	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	0.93	4,246,380.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	28.20	1,677,900.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	3.06	1,866,600.00	
	CGN POWER CO LTD-H	791,000	2.32	1,835,120.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	305,600	14.02	4,284,512.00	

	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	339,000	17.90	6,068,100.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	4.51	3,003,660.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	40.30	4,271,800.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	22.05	3,867,570.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	83,300	129.20	10,762,360.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	10.36	3,315,200.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	4.39	1,624,300.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	7.67	2,761,200.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	34.00	2,176,000.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	40.80	1,836,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	531,987	12.26	6,522,160.62	
香港ドル 小計		95,375,084		1,582,182,372.91 (23,210,615,410)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.70	1,116,903.60	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	19.24	482,924.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	8.98	2,423,702.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	5.88	1,696,968.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.60	290,320.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.24	753,415.04	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	5.66	603,322.04	
	MISC BHD	125,040	7.01	876,530.40	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	3.85	269,500.00	
	GENTING BHD	188,500	4.53	853,905.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.84	1,049,948.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	5,800	25.74	149,292.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.85	1,040,809.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,146	21.40	752,124.40	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	131.90	949,680.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	16.60	1,219,768.00	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.01	625,248.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	3.98	983,243.08	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	181,300	5.74	1,040,662.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.56	1,504,208.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	2.24	1,130,976.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.52	1,058,464.00	

	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	650,575	5.33	3,467,564.75	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	19.50	1,195,194.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	18.40	306,047.20	
	MALAYAN BANKING BHD	571,105	8.32	4,751,593.60	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,675,000	4.18	7,001,500.00	
	RHB BANK BHD	210,820	5.76	1,214,323.20	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	3.28	901,016.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.77	1,075,539.53	
	DIGI.COM BERHAD	311,700	3.91	1,218,747.00	
	MAXIS BHD	267,900	4.44	1,189,476.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	5.12	361,226.24	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	16.74	1,263,870.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	305,275	9.07	2,768,844.25	
マレーシアリンギット 小計		8,988,001		47,586,854.33 (1,298,930,775)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	134,400	127.50	17,136,000.00	
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	39.00	46,698,600.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	52.50	6,305,250.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	48.50	10,010,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	58.25	13,102,405.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	61.25	6,161,750.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	380.00	30,780,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	527,000	61.25	32,278,750.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.15	6,658,550.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	9.15	7,406,925.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.62	3,743,586.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	30.00	10,882,140.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	32.75	5,967,050.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,035	14.10	6,641,593.50	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	25.50	7,369,500.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	30.00	5,328,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	691,700	58.00	40,118,600.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	111.00	5,139,300.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	25.50	14,188,200.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	33.00	2,178,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	19.50	3,605,550.00	

	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	21.90	25,774,110.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	135.00	11,164,500.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	73,600	28.75	2,116,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	13.70	6,009,505.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	88,700	122.50	10,865,750.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	20.10	3,318,510.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	59.75	6,064,625.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	58.00	5,208,400.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	63.75	4,864,125.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	53.00	11,993,900.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.90	7,760,800.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	398.00	15,482,200.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	222.00	26,573,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	77.75	9,473,837.50	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	4.88	4,691,675.92	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	38.00	2,029,200.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	173.00	2,923,700.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	129,400	94.75	12,260,650.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	85.25	5,814,050.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	288,200	50.75	14,626,150.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	44.50	2,416,350.00	
タイバーツ 小計		13,300,316		473,131,588.42 (1,641,766,611)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	62.30	14,823,662.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	850.00	24,038,000.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	552.00	3,785,616.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	58.00	17,603,754.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	959.00	21,869,995.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	96,110	204.40	19,644,884.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	230.40	14,056,704.00	
	MONDE NISSIN CORP	490,500	16.58	8,132,490.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	127.00	12,136,120.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	94.30	20,040,164.50	
	BDO UNIBANK INC	219,911	127.90	28,126,616.90	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	58.00	9,354,646.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.88	9,140,116.00	

	AYALA LAND INC	794,100	35.00	27,793,500.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,003,150	34.35	34,458,202.50	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	3,360.00	15,758,400.00	
	PLDT INC	10,460	1,888.00	19,748,480.00	
	AC ENERGY CORP	737,000	9.50	7,001,500.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	309.00	8,994,990.00	
フィリピンペソ 小計		6,870,499		316,507,840.90 (702,299,248)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	2,230.00	3,209,639,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,250.00	4,670,925,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,725.00	1,700,505,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	820.00	2,363,650,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	7,500.00	1,831,500,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	10,675.00	2,028,250,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,542,100	3,840.00	5,921,664,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	6,675.00	2,306,880,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,218,400	5,600.00	12,423,040,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	792,300	6,400.00	5,070,720,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	31,125.00	1,855,050,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,750.00	1,408,750,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,425.00	2,756,967,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	4,100.00	3,060,240,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,700.00	4,685,030,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	5,772,500	7,675.00	44,303,937,500.00	
	BANK MANDIRI	2,163,796	7,025.00	15,200,666,900.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	7,100.00	5,752,420,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	7,392,902	4,130.00	30,532,685,260.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,030.00	2,925,818,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,601,300	4,250.00	23,805,525,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	1,076,100	2,960.00	3,185,256,000.00	
インドネシアルピア 小計		40,650,498		180,999,119,160.00 (1,447,992,953)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	39,850.00	262,731,050.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	95,200.00	423,354,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	261,500.00	1,460,739,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	38,800.00	480,382,800.00	

	HYUNDAI STEEL CO	11,189	42,500.00	475,532,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	555,000.00	434,565,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	164,000.00	311,272,000.00	
	LG CHEM LTD	4,869	653,000.00	3,179,457,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	309,500.00	271,431,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	213,000.00	411,090,000.00	
	POSCO	8,093	284,500.00	2,302,458,500.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	125,500.00	420,425,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,122	138,500.00	155,397,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,500	141,500.00	212,250,000.00	
	SKC CO LTD	1,734	153,000.00	265,302,000.00	
	CJ CORP	1,230	79,700.00	98,031,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	39,650.00	170,812,200.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	37,707	19,100.00	720,203,700.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,170	431,900.00	505,323,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	40,700.00	275,132,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	42,700.00	417,093,600.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	5,180	51,000.00	264,180,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,139	34,800.00	248,437,200.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	91,300.00	397,520,200.00	
	LG CORP	9,026	78,100.00	704,930,600.00	
	SAMSUNG C&T CORP	8,727	111,000.00	968,697,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	23,300.00	431,422,800.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	59,306	5,450.00	323,217,700.00	
	SK INC	4,545	235,500.00	1,070,347,500.00	
	S-1 CORPORATION	840	71,100.00	59,724,000.00	
	CJ LOGISTICS	862	120,000.00	103,440,000.00	
	HMM CO LTD	25,309	24,350.00	616,274,150.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,586	164,000.00	260,104,000.00	
	KOREAN AIR LINES CO LTD	23,739	27,550.00	654,009,450.00	
	STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,170.00	153,735,120.00	
	HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	36,050.00	254,729,300.00	
	HANON SYSTEMS	19,000	11,550.00	219,450,000.00	
	HYUNDAI MOBIS	7,116	240,000.00	1,707,840,000.00	
	HYUNDAI MOTOR CO	14,897	200,500.00	2,986,848,500.00	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	100,500.00	306,625,500.00	

	HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	98,500.00	339,726,500.00	
	KIA CORP	29,259	81,000.00	2,369,979,000.00	
	COWAY CO LTD	5,058	71,400.00	361,141,200.00	
	F&F CO LTD / NEW	320	878,000.00	280,960,000.00	
	HLB INC	10,012	32,850.00	328,894,200.00	
	LG ELECTRONICS INC	11,019	137,000.00	1,509,603,000.00	
	KANGWON LAND INC	7,703	25,350.00	195,271,050.00	
	CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	22,300.00	113,061,000.00	
	HYBE CO LTD	1,547	274,500.00	424,651,500.00	
	KAKAO CORP	34,497	90,400.00	3,118,528,800.00	
	KAKAO GAMES CORP	3,021	68,000.00	205,428,000.00	
	KRAFTON INC	2,345	324,500.00	760,952,500.00	
	NAVER CORP	13,595	332,500.00	4,520,337,500.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,939	582,000.00	1,128,498,000.00	
	NETMARBLE CORP	2,465	105,500.00	260,057,500.00	
	PEARL ABYSS CORP	4,605	107,500.00	495,037,500.00	
	CJ ENM CO LTD	830	130,300.00	108,149,000.00	
	HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	73,900.00	225,468,900.00	
	LOTTE SHOPPING CO	1,034	82,400.00	85,201,600.00	
	BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	159,500.00	87,565,500.00	
	EMART	1,864	142,000.00	264,688,000.00	
	CJ CHEILJEDANG CORP	775	367,000.00	284,425,000.00	
	KT&G CORP	13,223	79,000.00	1,044,617,000.00	
	ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	102,000.00	320,484,000.00	
	AMOREPACIFIC CORP	3,762	150,000.00	564,300,000.00	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	955,000.00	912,980,000.00	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	389	545,000.00	212,005,000.00	
	PACIFIC CORP	3,393	41,050.00	139,282,650.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,851	66,800.00	591,246,800.00	
	SD BIOSENSOR INC	3,909	51,400.00	200,922,600.00	
	ALTEOGEN INC	2,841	57,100.00	162,221,100.00	
	CELLTRION INC	10,890	167,000.00	1,818,630,000.00	
	CELLTRION PHARM INC	1,968	88,900.00	174,955,200.00	
	GREEN CROSS CORP	564	185,500.00	104,622,000.00	
	HANMI PHARM CO LTD	508	251,500.00	127,762,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,870	816,000.00	1,525,920,000.00	

	SEEGENE INC	3,838	54,200.00	208,019,600.00	
	SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	3,049	24,600.00	75,005,400.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	85,200.00	272,384,400.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	186,000.00	390,600,000.00	
	YUHAN CORPORATION	6,107	59,500.00	363,366,500.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	33,962	46,950.00	1,594,515,900.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,650.00	301,714,500.00	
	KAKAOBANK CORP	10,063	41,800.00	420,633,400.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	42,887	61,900.00	2,654,705,300.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	50,883	39,500.00	2,009,878,500.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	15,050.00	894,060,300.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	77,500.00	356,655,000.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	6,460.00	309,459,840.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	8,440.00	261,766,600.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	11,800.00	142,862,600.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	41,650.00	240,570,400.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	65,000.00	273,585,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	216,500.00	672,882,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	66,100.00	490,263,700.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	1,451	58,800.00	85,318,800.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	148,000.00	551,300,000.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	2,166	107,500.00	232,845,000.00	
	L&F CO LTD	2,281	194,100.00	442,742,100.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	22,700.00	546,411,700.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	371,500.00	525,672,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,845	187,500.00	1,283,437,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	520,395	76,300.00	39,706,138,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	88,687	70,600.00	6,261,302,200.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,892	661,000.00	3,894,612,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	13,200.00	292,050,000.00	
	SK TELECOM	9,599	55,800.00	535,624,200.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	20,950.00	554,316,050.00	
	SK HYNIX INC	60,303	127,000.00	7,658,481,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	6,205	62,300.00	386,571,500.00	
韓国ウォン 小計		1,719,142		125,241,841,860.00 (12,048,265,186)	

新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	98.20	11,021,968.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	44.40	10,397,414.40	
	CHINA STEEL	1,266,261	34.05	43,116,187.05	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	79.90	33,562,873.90	
	FORMOSA PLASTICS CORP	441,824	106.00	46,833,344.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	561,752	87.40	49,097,124.80	
	TAIWAN CEMENT	589,511	47.60	28,060,723.60	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,557	960.00	12,054,720.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	29.15	10,145,016.20	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	23,207	275.00	6,381,925.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	6,000	1,495.00	8,970,000.00	
	EVERGREEN MARINE	266,039	122.50	32,589,777.50	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	150,000	28.80	4,320,000.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	64,900	161.50	10,481,350.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	180,000	104.00	18,720,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	35.35	6,259,106.35	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	608.00	12,121,696.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	236.50	10,275,452.00	
	GIANT MANUFACTURING	34,464	325.50	11,218,032.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	394.50	6,312,000.00	
	POU CHEN	273,780	32.55	8,911,539.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	607.00	18,210,000.00	
	MOMO.COM INC	5,000	1,505.00	7,525,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	271.50	16,166,196.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	494,395	68.30	33,767,178.50	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	20,000	246.00	4,920,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	587,664	18.00	10,577,952.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,011,237	27.80	55,912,388.60	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,397,452	29.00	40,526,108.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,248,238	25.35	31,642,833.30	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,059,344	22.40	23,729,305.60	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,211,339	37.00	44,819,543.00	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	16.95	19,609,268.55	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,009,432	20.55	20,743,827.60	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,078,434	27.00	29,117,718.00	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	451,861	48.50	21,915,258.50	

	CHAILEASE HOLDING CO LTD	144,167	257.50	37,123,002.50	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,056,159	25.70	27,143,286.30	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	66.10	58,704,930.30	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,896,226	18.85	35,743,860.10	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	810,435	78.80	63,862,278.00	
	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,262,866	11.55	14,586,102.30	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	206,724	66.00	13,643,784.00	
	ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	267.50	12,840,000.00	
	ACER INC	255,803	30.70	7,853,152.10	
	ADVANTECH CO LTD	43,336	389.50	16,879,372.00	
	ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	378.00	27,250,776.00	
	AU OPTRONICS CORP	945,090	21.75	20,555,707.50	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	161.50	11,256,550.00	
	CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,049,000	18.40	19,301,600.00	
	COMPAL ELECTRONICS	431,760	25.45	10,988,292.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	217,903	275.00	59,923,325.00	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	62.00	5,756,700.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,368,248	103.50	141,613,668.00	
	INVENTEC CO LTD	280,511	25.15	7,054,851.65	
	LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	2,100.00	23,184,000.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	63.60	14,338,747.20	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	158.00	9,480,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	519.00	10,899,000.00	
	PEGATRON CORP	200,474	71.00	14,233,654.00	
	QUANTA COMPUTER INC	286,270	93.40	26,737,618.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	68.00	8,710,800.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	141,000	215.50	30,385,500.00	
	WISTRON CORP	242,695	30.95	7,511,410.25	
	WIWYNN CORP	8,000	1,085.00	8,680,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	54.40	7,816,844.80	
	YAGEO CORPORATION	38,764	487.50	18,897,450.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	101.00	6,052,122.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	410,315	117.00	48,006,855.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	64.90	10,189,300.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	192,200	101.00	19,412,200.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	359,315	105.00	37,728,075.00	

	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,580.00	4,740,000.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,755.00	10,530,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	795.00	19,080,000.00	
	MEDIATEK INC	165,804	1,100.00	182,384,400.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	75.20	8,648,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,045	506.00	29,370,770.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,990.00	15,920,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	541.00	27,560,704.00	
	SILERGY CORP	9,000	3,820.00	34,380,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,677,389	654.00	1,751,012,406.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,316,000	62.80	82,644,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	138.50	12,326,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	333.00	10,656,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	30.45	10,627,050.00	
新台湾ドル 小計		35,789,489		3,854,258,271.45 (15,938,514,229)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	394.35	37,944,751.35	
	COAL INDIA LTD	180,326	163.90	29,555,431.40	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	324.35	19,274,498.75	
	INDIAN OIL CORP LTD	193,765	125.10	24,240,001.50	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	170.25	43,023,707.25	
	PETRONET LNG LTD	83,779	218.20	18,280,577.80	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	309,735	2,521.60	781,027,776.00	
	ACC LTD	5,315	2,231.80	11,862,017.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	374.85	27,563,845.05	
	ASIAN PAINTS LTD	42,204	3,280.40	138,446,001.60	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	748.45	22,041,104.05	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,806.50	56,957,138.50	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	504.80	91,116,904.80	
	JSW STEEL LTD	99,332	674.65	67,014,333.80	
	PI INDUSTRIES LTD	8,147	2,692.80	21,938,241.60	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,673.40	48,653,206.60	
	SHREE CEMENT LTD	1,387	26,402.25	36,619,920.75	
	SRF LTD	14,609	2,556.90	37,353,752.10	
	TATA STEEL LTD	77,326	1,209.60	93,533,529.60	
	ULTRATECH CEMENT LTD	11,556	7,434.40	85,911,926.40	

	UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	813.25	44,081,403.00	
	VEDANTA LTD	147,245	324.60	47,795,727.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	26,979	1,849.30	49,892,264.70	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	116,287	208.15	24,205,139.05	
	HAVELLS INDIA LTD	23,476	1,308.75	30,724,215.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	71,836	2,020.90	145,173,372.40	
	SIEMENS INDIA LTD	5,926	2,380.35	14,105,954.10	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	875.95	20,140,718.35	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	64,743	744.20	48,181,740.60	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	671.20	17,756,596.00	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	2,079.50	17,384,620.00	
	BAJAJ AUTO LTD	9,644	3,436.80	33,144,499.20	
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,504.25	22,115,031.75	
	BHARAT FORGE LTD	30,322	758.35	22,994,688.70	
	EICHER MOTORS LTD	14,685	2,718.70	39,924,109.50	
	HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,699.80	33,040,152.40	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	101,669	894.40	90,932,753.60	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	15,707	8,015.70	125,902,599.90	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	124,426	184.50	22,956,597.00	
	MRF LTD	133	76,529.85	10,178,470.05	
	TATA MOTORS LTD	190,082	520.85	99,004,209.70	
	PAGE INDUSTRIES LTD	601	43,390.40	26,077,630.40	
	TITAN INDUSTRIES LTD	40,781	2,588.90	105,577,930.90	
	JUBILANT FOODWORKS LTD	8,786	3,741.50	32,872,819.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	7,855	5,016.70	39,406,178.50	
	TRENT LTD	19,255	1,167.55	22,481,175.25	
	ZOMATO LTD	170,264	129.20	21,998,108.80	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	4,483.40	78,567,101.60	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,474	3,575.65	41,027,008.10	
	ITC LTD	345,135	220.35	76,050,497.25	
	NESTLE INDIA LIMITED	3,906	18,937.00	73,967,922.00	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	717.65	43,785,979.45	
	UNITED SPIRITS LTD	32,483	923.55	29,999,674.65	
	COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,447.45	13,846,306.70	
	DABUR INDIA LTD	58,111	568.55	33,039,009.05	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	937.55	36,061,923.20	

	HINDUSTAN UNILEVER LTD	89,298	2,309.90	206,269,450.20	
	MARICO LTD	42,465	494.40	20,994,696.00	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,114	4,515.95	45,674,318.30	
	AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	670.50	23,745,757.50	
	BIOCON LTD	58,256	367.35	21,400,341.60	
	CIPLA LTD	49,816	895.65	44,617,700.40	
	DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	4,481.50	66,245,533.00	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,684.95	59,236,507.80	
	LUPIN LTD	26,552	959.45	25,475,316.40	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	97,015	838.50	81,347,077.50	
	TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,110	3,201.15	19,559,026.50	
	AXIS BANK LTD	247,821	729.60	180,810,201.60	
	BANDHAN BANK LTD	74,811	303.60	22,712,619.60	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	187,327	2,620.25	490,843,571.75	
	ICICI BANK LTD	563,039	808.60	455,273,335.40	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	62,523	1,905.65	119,146,954.95	
	STATE BANK OF INDIA	187,504	515.80	96,714,563.20	
	YES BANK LTD	1,020,164	13.80	14,078,263.20	
	BAJAJ FINANCE LTD	30,037	7,571.80	227,434,156.60	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,888	18,077.30	70,284,542.40	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	612.10	23,592,170.30	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	2,394.20	9,804,249.00	
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,475.10	18,325,167.30	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	2,570.60	30,132,573.20	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	870.35	26,992,164.55	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,195.30	25,359,484.80	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	94,500	656.05	61,996,725.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,423.00	33,497,420.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	573.80	18,207,821.60	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,248.10	67,110,337.00	
	DLF LTD	56,420	408.25	23,033,465.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,851.20	23,554,668.80	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	123,161	1,199.20	147,694,671.20	
	INFOSYS LTD	370,852	1,867.05	692,399,226.60	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	6,697.05	38,548,219.80	
	MINDTREE LTD	6,247	4,226.20	26,401,071.40	

	MPHASIS LTD	7,796	3,088.25	24,075,997.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	102,286	3,914.65	400,413,889.90	
	TECH MAHINDRA LTD	72,109	1,670.10	120,429,240.90	
	WIPRO LTD	144,908	621.15	90,009,604.20	
	BHARTI AIRTEL LTD	266,977	703.70	187,871,714.90	
	INDUS TOWERS LTD	90,578	270.70	24,519,464.60	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	1,938.45	82,539,201.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	26,949	1,794.90	48,370,760.10	
	ADANI TRANSMISSION LTD	27,228	2,043.25	55,633,611.00	
	GAIL INDIA LTD	174,768	147.95	25,856,925.60	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	438.60	11,721,146.40	
	NTPC LTD	513,123	134.80	69,168,980.40	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	327,337	204.65	66,989,517.05	
	TATA POWER CO LTD	145,582	248.50	36,177,127.00	
インドルピー 小計		9,356,746		8,129,043,342.25 (12,600,017,180)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	60,443	18.10	1,094,018.30	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	296,777	3.47	1,031,893.62	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.45	1,089,835.87	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	16.80	3,306,038.40	
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	7.43	1,516,257.67	
	MASRAF AL RAYAN	406,540	5.16	2,097,746.40	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	10.24	1,009,244.16	
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	20.10	2,296,023.00	
	QATAR NATIONAL BANK	484,445	21.80	10,560,901.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.40	705,466.00	
	OOREDOO QSC	72,800	7.23	526,344.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	17.17	1,071,768.57	
カタールリアル 小計		2,648,408		26,305,536.99 (823,626,363)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	180.15	4,056,978.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	245.11	3,595,763.70	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,119	1,805.57	11,048,282.83	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	39,424	296.08	11,672,657.92	
	GOLD FIELDS LTD	97,102	157.00	15,245,014.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	59.69	3,360,606.69	

	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	91,758	229.99	21,103,422.42	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	543.21	2,918,124.12	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	33,950	208.76	7,087,402.00	
	SASOL LTD	57,207	315.81	18,066,542.67	
	SIBANYE STILLWATER LTD	313,727	58.65	18,400,088.55	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	192.98	5,345,931.96	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	118.24	4,792,148.96	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	211.96	6,042,979.60	
	NASPERS LTD-N SHS	23,206	2,521.59	58,516,017.54	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	144,533	23.50	3,396,525.50	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	54.90	6,066,175.50	
	BID CORP LTD	35,017	332.57	11,645,603.69	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	313.89	8,450,232.69	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	60,003	207.76	12,466,223.28	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	174.71	4,066,200.54	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	182.31	2,374,223.13	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	205.00	7,635,020.00	
	ABSA GROUP LTD	73,296	161.41	11,830,707.36	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,544	2,019.00	17,250,336.00	
	NEDBANK GROUP LTD	44,497	183.00	8,142,951.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	150,257	143.91	21,623,484.87	
	FIRSTRAND LTD	560,323	64.77	36,292,120.71	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	304.41	5,231,894.67	
	REMGRO LTD	55,441	130.99	7,262,216.59	
	DISCOVERY LIMITED	48,488	143.37	6,951,724.56	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	13.67	6,692,996.04	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	45.59	4,616,808.12	
	SANLAM LTD	214,053	61.35	13,132,151.55	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	60,556	106.11	6,425,597.16	
	MTN GROUP LTD	194,516	163.78	31,857,830.48	
	VODACOM GROUP	62,331	134.68	8,394,739.08	
南アフリカランド 小計		3,388,976		433,057,723.48 (3,234,941,194)	
アラブ首長国連邦ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	271,405	4.18	1,134,472.90	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	8.73	2,855,041.74	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	6.85	1,272,599.85	

	DUBAI ISLAMIC BANK	335,455	5.45	1,828,229.75	
	EMIRATES NBD PJSC	265,296	12.80	3,395,788.80	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	486,542	20.68	10,061,688.56	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	367,539	4.13	1,517,936.07	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	4.85	1,867,444.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	375,599	30.12	11,313,041.88	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		2,999,695		35,246,243.55 (1,095,100,787)	
クウェートディナール	AGILITY	142,931	0.99	141,787.55	
	BOUBYAN BANK K.S.C	130,019	0.82	107,265.67	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	514,294	0.90	466,978.95	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	722,881	1.04	755,410.64	
	MABANEE CO KPSC	67,003	0.82	54,942.46	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	215,000	0.59	128,140.00	
クウェートディナール 小計		1,792,128		1,654,525.27 (626,667,991)	
香港・オフショア人民元	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	23.51	470,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	5.50	550,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	12.92	494,836.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	12.84	1,127,352.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	45.27	1,267,560.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	23.86	1,460,232.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.97	980,871.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	42.94	1,264,153.60	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	7.70	297,990.00	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	46.48	957,488.00	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	78,847	15.07	1,188,224.29	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	41.28	858,624.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	8,000	123.08	984,640.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	12,413	95.23	1,182,089.99	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	24.43	906,353.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	21.17	211,700.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	2.57	1,184,770.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	5.11	306,600.00	
	JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	18.32	408,536.00	
	KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	12.65	384,560.00	

	LB GROUP CO LTD-A	15,300	26.99	412,947.00	
	NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	16.74	1,325,808.00	
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	3.93	864,993.00	
	RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	19.14	927,333.00	
	SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	28,320	42.79	1,211,812.80	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	19.25	139,601.00	
	SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	31.38	562,957.20	
	SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	4.78	1,369,948.00	
	SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	5,600	144.80	810,880.00	
	SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	7.43	1,020,882.00	
	SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	17.47	861,271.00	
	SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	6,000	97.37	584,220.00	
	TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	22.20	217,560.00	
	TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	8.41	775,402.00	
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	96.47	1,688,225.00	
	WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	70.68	651,669.60	
	YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	8.74	972,762.00	
	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	265.65	2,762,760.00	
	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	5,700	103.03	587,271.00	
	ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	12.85	303,260.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	105,600	9.89	1,044,384.00	
	AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	52.00	592,800.00	
	AVICOPTER PLC-A	15,500	64.65	1,002,075.00	
	BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	36.51	306,684.00	
	CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	14.35	918,400.00	
	CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	23.10	1,275,466.50	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.37	1,132,533.00	
	CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	15,100	569.99	8,606,849.00	
	CRRC CORP LTD-A	185,800	6.17	1,146,386.00	
	EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	98.98	749,575.54	
	FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	10.11	230,508.00	
	GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	43.81	254,098.00	
	GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	172.68	1,087,884.00	
	HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	38.04	517,344.00	
	HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	18,800	67.50	1,269,000.00	
	JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	84.88	972,385.28	

	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	19.77	950,937.00	
	METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	4.07	1,346,763.00	
	MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	22.57	817,034.00	
	NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	58,320	40.32	2,351,462.40	
	POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	8.73	1,424,736.00	
	SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	24.35	1,020,265.00	
	SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	10,650	66.00	702,900.00	
	SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	17,900	11.11	198,869.00	
	SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	120.71	1,207,100.00	
	SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	1,600	522.80	836,480.00	
	TBEA CO LTD-A	22,519	20.00	450,380.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	17.09	738,288.00	
	WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	3,800	139.50	530,100.00	
	XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.14	1,224,316.00	
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	14.99	301,463.89	
	YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	28,280	31.50	890,820.00	
	ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	49.11	1,551,876.00	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	79.12	653,531.20	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	24.40	1,151,436.00	
	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	7.66	613,566.00	
	BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	7.10	572,260.00	
	SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	56.09	616,990.00	
	AIR CHINA LTD-A	25,900	9.63	249,417.00	
	BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	106,700	4.91	523,897.00	
	CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.34	213,600.00	
	S F HOLDING CO LTD-A	20,300	65.70	1,333,710.00	
	SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	49.67	264,194.73	
	SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.88	261,072.00	
	YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	21.06	459,950.40	
	BYD CO LTD -A	9,700	252.97	2,453,809.00	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	33,348	13.87	462,536.76	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	47.87	885,595.00	
	HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	29.19	1,001,217.00	
	NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	21.06	617,058.00	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	20.04	853,704.00	
	SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	32.40	1,271,829.60	

	BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	1,031	906.59	934,694.29	
	ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	139.55	390,740.00	
	HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	36.99	1,026,842.40	
	JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	6,102	75.12	458,382.24	
	NAVINFO CO LTD-A	33,200	17.20	571,040.00	
	OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	143.64	1,106,028.00	
	QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	28.95	752,700.00	
	TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	6.13	625,260.00	
	ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	55.73	445,840.00	
	SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	56.08	1,469,296.00	
	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	8.17	647,881.00	
	SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	15.27	511,239.60	
	BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	11.54	618,544.00	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	7.76	1,081,744.00	
	G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	398.13	1,154,577.00	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	45.13	735,619.00	
	PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	17.16	391,248.00	
	WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	28.07	687,715.00	
	ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	8.21	504,915.00	
	CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	188.62	2,301,164.00	
	SUNING.COM CO LTD-A	45,800	4.13	189,154.00	
	DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	15,480	41.98	649,850.40	
	LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	8,600	47.80	411,080.00	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	55.99	567,738.60	
	YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	4.24	171,720.00	
	ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	53.85	576,195.00	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	203.40	325,440.00	
	ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	63.11	138,842.00	
	BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	9.36	556,920.00	
	BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	34.68	357,204.00	
	CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	56.97	569,700.00	
	CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	127.50	1,007,250.00	
	CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	33.45	153,870.00	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	18,408	103.97	1,913,879.76	
	FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	3,000	146.03	438,090.00	
	FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	22.72	622,528.00	

	GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	69.94	1,188,980.00	
	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	31.60	37,920.00	
	INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	39.31	1,348,411.62	
	JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	50.73	877,629.00	
	JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	161.01	1,465,191.00	
	JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	9.56	264,812.00	
	JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	178.00	996,800.00	
	JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	34.11	392,265.00	
	JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	58.30	408,100.00	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	1,912.00	14,531,200.00	
	LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	229.89	2,252,922.00	
	MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	54.53	1,829,917.74	
	NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	16.49	441,932.00	
	SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	277.75	2,605,295.00	
	TONGWEI CO LTD-A	31,600	40.51	1,280,116.00	
	WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	19.25	734,580.00	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	210.80	4,468,960.00	
	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	61.91	625,291.00	
	YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	20.26	107,378.00	
	BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	26.18	777,546.00	
	AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	23,226	35.46	823,593.96	
	AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	6,500	58.15	377,975.00	
	CHINA NATIONAL MEDICINES-A	33,700	30.30	1,021,110.00	
	GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	87.21	247,501.98	
	HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	38.39	373,150.80	
	INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	7,875	63.73	501,873.75	
	JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	56.12	693,082.00	
	JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	18,000	32.90	592,200.00	
	JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	14.26	148,304.00	
	LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	23.40	346,320.00	
	MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	7.69	191,019.60	
	OVCTEK CHINA INC-A	7,209	48.25	347,834.25	
	SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	335.22	2,815,848.00	
	TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	165.20	330,400.00	
	WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	15.43	583,716.90	
	ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	358.00	71,600.00	

	BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	23,400	30.71	718,614.00	
	BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	5,167	226.00	1,167,742.00	
	BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	74.75	1,203,475.00	
	BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	92.21	507,155.00	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	227.60	500,720.00	
	CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	36.10	368,220.00	
	CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	106.38	1,053,162.00	
	DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	40.67	902,589.31	
	GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	32.34	517,440.00	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	118.90	951,200.00	
	HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	28.15	530,627.50	
	IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	467.60	972,608.00	
	JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	45.73	1,742,404.46	
	JOINN LABORATORIES CHINA C-A	7,940	98.52	782,248.80	
	NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	21,294	37.30	794,266.20	
	SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.22	462,802.00	
	SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	88.25	600,100.00	
	SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	25.33	177,310.00	
	SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	59,640	25.29	1,508,295.60	
	SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	19.80	222,393.60	
	WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	53.30	906,100.00	
	WUXI APPTEC CO LTD-A	16,464	112.00	1,843,968.00	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	98.75	701,125.00	
	ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	3,900	391.00	1,524,900.00	
	ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	22.41	202,138.20	
	ZHEJIANG NHU CO LTD-A	29,040	30.80	894,432.00	
	ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	52.10	505,370.00	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	2.98	1,053,728.00	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.58	265,640.00	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.80	474,720.00	
	BANK OF JIANGSU CO LTD-A	75,140	6.72	504,940.80	
	BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	9.89	499,445.00	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	26,400	39.46	1,041,744.00	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	7.26	330,330.00	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.05	755,645.00	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.44	443,416.00	

	CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	49.70	5,213,530.00	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.96	1,083,456.00	
	CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	3.54	1,092,444.00	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.76	687,744.00	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.70	1,227,640.00	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	21.51	2,047,752.00	
	PING AN BANK CO LTD-A	119,400	16.50	1,970,100.00	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.65	799,475.00	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	8.64	1,194,912.00	
	AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.94	482,650.00	
	BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	12.92	1,025,848.00	
	CAITONG SECURITIES CO LTD-A	44,100	10.37	457,317.00	
	CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	7.28	144,872.00	
	CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	12.13	566,471.00	
	CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	16.96	486,073.60	
	CITIC SECURITIES CO-A	43,200	25.70	1,110,240.00	
	CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	28.01	675,041.00	
	EAST MONEY INFORMATION CO-A	41,880	33.15	1,388,322.00	
	EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	14.46	52,056.00	
	FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	7.02	422,604.00	
	FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	7.80	645,840.00	
	GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	22.27	1,349,562.00	
	GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	127,170	8.65	1,100,020.50	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	17.85	1,290,555.00	
	GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.50	1,140,375.00	
	HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	131.06	707,724.00	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	17.51	551,565.00	
	INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	9.23	811,317.00	
	NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	9.68	413,336.00	
	ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	13.42	425,414.00	
	SDIC CAPITAL CO LTD-A	69,616	8.01	557,624.16	
	SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	5.04	1,044,288.00	
	SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	5.06	576,840.00	
	TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	94,600	3.94	372,724.00	
	ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	12.81	559,797.00	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	27.66	503,412.00	

	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	51.45	3,436,860.00	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	13.86	758,142.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	21.90	1,176,030.00	
	GEMDALE CORP-A	45,500	13.66	621,530.00	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	123,480	4.54	560,599.20	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	16.09	1,316,162.00	
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	33.40	427,520.00	
	SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	14.80	125,800.00	
	360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	12.62	339,478.00	
	BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	272.51	1,314,315.73	
	BEIJING SHIJI INFORMATION -A	18,900	27.90	527,310.00	
	BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	16.07	462,816.00	
	CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	78,400	16.00	1,254,400.00	
	DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	8.18	455,626.00	
	HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	12,740	59.92	763,380.80	
	IFLYTEK CO LTD - A	10,800	48.45	523,260.00	
	SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	181.10	543,300.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	6,110	63.33	386,946.30	
	THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	149.66	823,130.00	
	YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	38.88	512,049.60	
	ADDSINO CO LTD -A	5,800	16.24	94,192.00	
	AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	38.87	1,473,173.00	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	4.96	568,416.00	
	CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	40.96	1,146,880.00	
	CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	15.16	527,568.00	
	FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	18.51	385,008.00	
	FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	11.64	524,964.00	
	GOERTEK INC -A	26,900	49.80	1,339,620.00	
	GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	6.89	344,500.00	
	GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	77.11	539,770.00	
	INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	36.42	717,911.04	
	LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	19.79	332,472.00	
	LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	47.46	2,204,517.00	
	MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,080	277.50	299,700.00	
	NINESTAR CORP-A	18,543	52.50	973,507.50	
	OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	9.19	287,647.00	

	SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	22.26	540,918.00	
	SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	115.30	548,828.00	
	SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	14.80	347,800.00	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	23.80	318,920.00	
	SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	141.95	913,448.25	
	SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	24.12	687,420.00	
	TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	12.95	608,650.00	
	UNISPLENDOUR CORP LTD-A	18,340	24.56	450,430.40	
	UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	15.01	42,028.00	
	WESTONE INFORMATION INDUST-A	20,100	48.60	976,860.00	
	WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	117.80	494,760.00	
	WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	29,512	23.86	704,156.32	
	WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	2,760	73.00	201,480.00	
	XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	201.62	947,614.00	
	YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	85.66	963,675.00	
	ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	20.74	628,422.00	
	ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	39.33	342,171.00	
	ZTE CORP-A	12,600	33.65	423,990.00	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	7.22	1,254,836.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	22.95	3,075,300.00	
	ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	18.48	1,027,488.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	10.29	695,604.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	116.86	829,355.42	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	3.43	282,975.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	6,272	157.90	990,348.80	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	10,800	115.30	1,245,240.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	51.33	384,975.00	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	112.08	840,600.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	17,450	88.30	1,540,835.00	
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	28.78	857,644.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	33,600	78.51	2,637,936.00	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	306.49	950,119.00	
	SG MICRO CORP-A	2,100	295.45	620,445.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	99.48	258,648.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	29,500	40.78	1,203,010.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	12.31	403,152.50	

	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	18.89	424,382.74	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	227.35	1,114,015.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,400	292.00	1,576,800.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	60.99	1,038,171.78	
香港・オフショア人民元 小計		13,562,566		281,105,496.78 (5,060,208,158)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	24.60	579,551.40	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	238,091	36.70	8,737,939.70	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	71.90	704,907.60	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	22.50	718,380.00	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	13,666	44.05	601,987.30	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	24,254	192.40	4,666,469.60	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	45.35	1,464,034.05	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	92.20	4,147,524.80	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	97,353	126.60	12,324,889.80	
	SAUDI CEMENT	7,489	55.90	418,635.10	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	34.30	722,323.70	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	18.90	1,954,845.90	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	71.90	1,909,376.40	
	JARIR MARKETING CO	7,199	200.80	1,445,559.20	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,725	110.40	411,240.00	
	ALMARAI CO	30,130	50.00	1,506,500.00	
	SAVOLA	25,336	34.45	872,825.20	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	6,923	166.00	1,149,218.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	4,029	189.40	763,092.60	
	AL RAJHI BANK	130,773	150.40	19,668,259.20	
	ALINMA BANK	109,956	27.65	3,040,283.40	
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	26.80	2,305,630.80	
	BANK AL-JAZIRA	35,813	22.38	801,494.94	
	BANK ALBILAD	45,859	53.10	2,435,112.90	
	BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	49.25	3,326,148.00	
	RIYAD BANK	138,943	32.45	4,508,700.35	
	SAUDI BRITISH BANK	94,400	41.55	3,922,320.00	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	236,442	74.10	17,520,352.20	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	133.60	810,016.80	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	79.00	522,427.00	

	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	10.34	486,931.28	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	12.66	584,727.42	
	ETIHAD ETISALAT CO	34,414	32.45	1,116,734.30	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	26,891	12.60	338,826.60	
	SAUDI TELECOM CO	66,310	121.00	8,023,510.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	25.40	2,342,413.40	
サウジアラビアリアル 小計		2,023,343		116,853,188.94 (3,566,359,326)	
合　計		278,921,675		98,138,356,943 (98,138,356,943)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	6,441,520.00	
	メキシコペソ 小計		58,400	6,441,520.00 (35,914,050)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	2,616,850.00	
		BANCO INTER SA-UNITS	31,500	708,750.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,446,768.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	681,615.00	
		KLABIN SA-UNIT	64,600	1,659,574.00	
	ブラジルレアル 小計		290,000	7,113,557.00 (149,273,014)	
投資信託受益証券合計			348,400	185,187,064 (185,187,064)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	6,689,196.00	
	メキシコペソ 小計		308,400	6,689,196.00 (37,294,943)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	6,884,180.54	
	南アフリカランド 小計		478,733	6,884,180.54 (51,424,828)	
投資証券合計			787,133	88,719,771 (88,719,771)	
合計				273,906,835 (273,906,835)	

(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　63銘柄	100.0%	—	—	6.7%
メキシコペソ	株式　22銘柄	96.3%	—	—	1.9%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	1.8%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	1.9%	0.0%
ブラジルレアル	株式　45銘柄	96.4%	—	—	4.1%
	投資信託受益証券　5銘柄	—	3.6%	—	0.2%
チリペソ	株式　11銘柄	100.0%	—	—	0.4%
コロンビアペソ	株式　5銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ユーロ	株式　6銘柄	100.0%	—	—	0.2%
イギリスポンド	株式　1銘柄	100.0%	—	—	0.1%
トルコリラ	株式　11銘柄	100.0%	—	—	0.3%
チェココルナ	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ハンガリーフォリント	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.3%
ポーランドズロチ	株式　15銘柄	100.0%	—	—	0.8%
香港ドル	株式　209銘柄	100.0%	—	—	23.6%
マレーシアリンギット	株式　35銘柄	100.0%	—	—	1.3%
タイバーツ	株式　42銘柄	100.0%	—	—	1.7%
フィリピンペソ	株式　19銘柄	100.0%	—	—	0.7%
インドネシアルピア	株式　22銘柄	100.0%	—	—	1.5%
韓国ウォン	株式　110銘柄	100.0%	—	—	12.2%
新台湾ドル	株式　86銘柄	100.0%	—	—	16.2%
インドルピー	株式　106銘柄	100.0%	—	—	12.8%
カタールリアル	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.8%
南アフリカランド	株式　37銘柄	98.4%	—	—	3.3%
	投資証券　1銘柄	—	—	1.6%	0.1%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式　9銘柄	100.0%	—	—	1.1%
クウェートディナール	株式　6銘柄	100.0%	—	—	0.6%
香港・オフショア人	株式　312銘柄	100.0%	—	—	5.1%

民元					
サウジアラビアリアル	株式　　36銘柄	100.0%	―	―	3.6%

(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。

２【ファンドの現況】

【世界経済インデックスファンド】

【純資産額計算書】

（2022年 2月 28日現在）

Ⅰ　資産総額	129,607,846,834円
Ⅱ　負債総額	210,152,686円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	129,397,694,148円
Ⅳ　発行済口数	46,763,450,272口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7671円
（1万口当たり純資産額）	（27,671円）

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 2月 28日現在）

Ⅰ　資産総額	634,098,010,094円
Ⅱ　負債総額	13,697,464,822円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	620,400,545,272円
Ⅳ　発行済口数	445,727,403,689口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3919円
（1万口当たり純資産額）	（13,919円）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 2月 28日現在）

Ⅰ　資産総額	467,182,586,514円
Ⅱ　負債総額	219,811,875円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	466,962,774,639円
Ⅳ　発行済口数	253,594,206,024口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8414円
（1万口当たり純資産額）	（18,414円）

外国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 2月 28日現在）

Ⅰ　資産総額	302,807,711,148円
Ⅱ　負債総額	184,805,953円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	302,622,905,195円
Ⅳ　発行済口数	100,578,120,596口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0088円
（1万口当たり純資産額）	（30,088円）

外国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 2月 28日現在）

Ⅰ　資産総額	499,691,635,924円
Ⅱ　負債総額	883,834,485円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	498,807,801,439円
Ⅳ　発行済口数	124,099,911,828口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.0194円
（1万口当たり純資産額）	（40,194円）

新興国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 2月 28日現在）

Ⅰ　資産総額	82,817,745,052円
Ⅱ　負債総額	32,643,600円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	82,785,101,452円
Ⅳ　発行済口数	47,822,117,998口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7311円
（1万口当たり純資産額）	（17,311円）

新興国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 2月 28日現在）

Ⅰ　資産総額	103,652,340,803円
Ⅱ　負債総額	1,449,988,100円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	102,202,352,703円
Ⅳ　発行済口数	29,141,053,793口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.5072円
（1万口当たり純資産額）	（35,072円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2022 年 2 月 28 日現在）

資本金の額　　：20 億円

発行可能株式総数　：12,000 株

発行済株式総数　　：3,000 株

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

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定しま

す。

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

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

委託会社の機構は 2022 年 4 月 20 日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022 年 2 月 28 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	536	14,909,551
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	71	247,430
単位型公社債投資信託	55	270,791
合計	662	15,427,772

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 52 年大蔵省令第 38 号）並びに同規則第 38 条及び第 57 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）により作成しております。

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

(2)　委託者は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 35 期事業年度（自　2020 年 4 月 1 日　至　2021 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 36 期事業年度の中間会計期間（自　2021 年 4 月 1 日　至　2021 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。

独立監査人の監査報告書

2021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	藤　澤　　孝　　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹　内　知　明　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「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 2020 年４月１日から2021 年３月 31 日までの第 35 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 2021 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。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応し

た監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	前事業年度 （2020年3月31日）		当事業年度 （2021年3月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		24,869		21,589
金銭の信託		5,823		10,857
前払費用		348		397
未収委託者報酬		7,284		8,471
未収運用受託報酬		5,842		6,151
未収収益		190		177
その他		4,624		3,428
流動資産合計		48,983		51,072
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	256	※1	301
器具備品	※1	576	※1	692
その他	※1	0	※1	0
有形固定資産合計		832		993
無形固定資産				
ソフトウェア		3,030		4,104
その他		40		41
無形固定資産合計		3,070		4,145
投資その他の資産				
投資有価証券		8,469		9,950
関係会社株式		5,636		5,636
繰延税金資産		700		311
その他		35		39
投資その他の資産合計		14,842		15,937
固定資産合計		18,745		21,077
資産合計		67,729		72,149

（単位：百万円）

	前事業年度 （2020年3月31日）	当事業年度 （2021年3月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
固定負債		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	305	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	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△587	791
繰延ヘッジ損益	284	△65
評価・換算差額等合計	△302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）	当事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	－
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848
一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	―	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	―
デリバティブ利益	666	―
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	―
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	―	158
デリバティブ費用	―	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	△193	△65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2019年4月1日　至　2020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	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
剰余金の配当	230		△2,536	△2,305	△2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	－	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	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	393	133	526	50,442
当期変動額				
剰余金の配当				△2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△980	151	△829	△829
当期変動額合計	△980	151	△829	6,022
当期末残高	△587	284	△302	56,464

当事業年度（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

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
時価のあるもの
決算日の市場価格等に基づく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。)
時価のないもの
移動平均法による原価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、原則として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
従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。
(2) 退職給付引当金
従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。
７．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。
８．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
消費税等の会計処理
消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。
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
「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。

注記事項

（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 （2020年3月31日）		当事業年度 （2021年3月31日）	
建 物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	〃	391	〃
そ の 他	4	〃	4	〃
計	367	〃	503	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2019年4月1日　至 2020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
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28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
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

当事業年度（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

2021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
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

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針 7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

２．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（(注2) を参照ください)。

前事業年度（2020年3月31日）　（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	－
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	－
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	－
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	－
(5) 投資有価証券 その他有価証券	8,469	8,469	－
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	－
(7) 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	6	6	－
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	－
デリバティブ取引計	(107)	(107)	－

(*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（2021年3月31日）　（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	21,589	21,589	－
(2) 金銭の信託	10,857	10,857	－
(3) 未収委託者報酬	8,471	8,471	－
(4) 未収運用受託報酬	6,151	6,151	－
(5) 投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	－
(6) 未払金	(7,572)	(7,572)	－
(7) 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)	(357)	－
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	－
デリバティブ取引計	(431)	(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。

（注 1） 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金
現金及び預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託
信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 投資有価証券 その他有価証券
投資有価証券の時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6) 未払金
未払金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(7) デリバティブ取引
（デリバティブ取引関係）注記をご参照ください。

（注 2） 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位:百万円）

区分	前事業年度 2020 年 3 月 31 日	当事業年度 2021 年 3 月 31 日
非上場株式	0	0

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（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（2020 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	24,869	－	－	－
未収委託者報酬	7,284	－	－	－
未収運用受託報酬	5,842	－	－	－
投資有価証券 投資信託	－	9	5,605	－

当事業年度（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

（有価証券関係）

１．子会社株式

前事業年度（2020 年 3 月 31 日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる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）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021 年 3 月 31 日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる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）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

２．その他有価証券

前事業年度（2020 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	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	△931
小計	7,578	8,509	△931
合計	8,469	9,316	△846

当事業年度（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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 0 百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2020年３月31日）　（単位:百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度（2021年３月31日）　（単位:百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2020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	1,443	－	△23	△23
	英ポンド	79	－	△1	△1
	カナダドル	15	－	△0	△0
	スイスフラン	26	－	△0	△0
	香港ドル	247	－	△4	△4
	人民元	18	－	△0	△0
	ユーロ	223	－	△2	△2
合計		2,055	－	△32	△32

（注）　1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2. 時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(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	8,412	－	358	358
合計		8,412	－	358	358

（注）　1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2. 時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	－	△44
	英ポンド		2,660	－	△67
	カナダドル		6	－	△0
	スイスフラン		35	－	△0
	香港ドル		71	－	△1
	ユーロ		72	－	△0
合計			5,666	－	△114

(注) 1. 時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（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) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2. 時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(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) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。
2. 時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

（注） 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（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す。

２．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	－	18
退職給付の支払額	△11	△69
退職給付債務の期末残高	600	626

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

（単位：百万円）

	前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用　前事業年度74百万円　　当事業年度77百万円

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 44 百万円、当事業年度 92 百万円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（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 （2020 年 3 月 31 日）		当事業年度 （2021 年 3 月 31 日）	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	〃	170	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	〃	191	〃
税務上の収益認識差額	―	〃	71	〃
有価証券評価差額	259	〃	―	〃
繰延ヘッジ損益	―	〃	28	〃
その他	151	〃	123	〃
繰延税金資産 合計	862	〃	693	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	―	〃	△349	〃
繰延ヘッジ損益	△125	〃	―	〃
その他	△35	〃	△32	〃
繰延税金負債 合計	△161	〃	△382	〃
繰延税金資産の純額	700	〃	311	〃

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。

（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 2019 年 4 月 1 日　至 2020 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	9,534 百万円

当事業年度（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(*1)	6,372百万円

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（持分法損益等）

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 2019年4月1日　至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
① 運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
② 投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2020年4月1日　至 2021年3月31日）

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

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
① 運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
② 投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

（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（2020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（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）

（１株当たり情報）

	前事業年度 （自　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85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　2019年4月1日 至　2020年3月31日）	当事業年度 （自　2020年4月1日 至　2021年3月31日）
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

独立監査人の中間監査報告書

2021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期事業年度の中間会計期間（2021年４月１日から2021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2021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（2021年４月１日から2021年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。

中間貸借対照表

（単位：百万円）

		第36期中間会計期間末 （2021年9月30日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		18,523
金銭の信託		15,986
未収委託者報酬		9,080
未収運用受託報酬		6,066
その他		5,520
流動資産合計		55,177
固定資産		
有形固定資産	※1	1,024
無形固定資産		5,276
投資その他の資産		
投資有価証券		6,629
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		208
その他		37
投資その他の資産合計		12,511
固定資産合計		18,813
資産合計		73,990
負債の部		
流動負債		
未払金		8,383
未払法人税等		474
賞与引当金		302
その他	※2	1,946
流動負債合計		11,106
固定負債		
退職給付引当金		781
資産除去債務		153
その他		10
固定負債合計		945
負債合計		12,051

（単位：百万円）

	第36期中間会計期間末 （2021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	39,182
利益剰余金合計	41,782
株主資本合計	61,022
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	995
繰延ヘッジ損益	△78
評価・換算差額等合計	916
純資産合計	61,938
負債・純資産合計	73,990

中間損益計算書

（単位：百万円）

		第36期中間会計期間 （自　2021年4月1日 至　2021年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		20,978
運用受託報酬		5,746
その他営業収益		201
営業収益合計		26,925
営業費用		15,801
一般管理費	※1	5,504
営業利益		5,620
営業外収益	※2	971
営業外費用	※3	1,067
経常利益		5,525
特別損失		120
税引前中間純利益		5,404
法人税、住民税及び事業税		1,663
法人税等調整額		19
法人税等合計		1,683
中間純利益		3,721

中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日　至 2021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	38,258	40,858	60,098
当中間期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797
中間純利益			3,721	3,721	3,721
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	－	－	923	923	923
当中間期末残高	500	2,100	39,182	41,782	61,022

	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
当中間期変動額				
剰余金の配当				△2,797
中間純利益				3,721
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	203	△13	190	190
当中間期変動額合計	203	△13	190	1,114
当中間期末残高	995	△78	916	61,938

重要な会計方針

第36期中間会計期間 （自　2021年4月1日 至　2021年9月30日）
1．資産の評価基準及び評価方法 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。 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）に基づく定額法によっております。 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．引当金の計上基準 (1) 賞与引当金 従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき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 従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、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」）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、ヘッジ対象は子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
「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。

(会計方針の変更)

第 36 期中間会計期間 （自　2021 年４月１日 至　2021 年９月 30 日）
１．「収益認識に関する会計基準」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。）等を当中間会計期間の期首から適用し、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。この変更が中間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」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。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第 19 項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第 10 号　2019 年７月４日）第 44-2 項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

(追加情報)

第 36 期中間会計期間 （自　2021 年４月１日 至　2021 年９月 30 日）
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、退職給付に係る中間期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、当中間会計期間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。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第36期中間会計期間末 （2021年9月30日）
※1　有形固定資産の減価償却累計額　591百万円 ※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36期中間会計期間 （自　2021年4月1日 至　2021年9月30日）
※1　減価償却実施額 有形固定資産　90百万円 無形固定資産　376百万円 ※2　営業外収益の主要項目 金銭の信託運用益　738百万円 投資有価証券償還益　219百万円 ※3　営業外費用の主要項目 デリバティブ費用　1,012百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日　至 2021年9月30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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式　（株）	3,000	－	－	3,000

２．配当に関する事項

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
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

（金融商品関係）
第36期中間会計期間末（2021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、市場価格のない非上場株式及び「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）第26 項に従い経過措置を適用した投資信託は、次表には含まれておりません。

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）時価をもって中間貸借対照表価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、*2)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	1,051	1,296	－	2,347
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	242	(103)	－	138
ヘッジ会計が適用されているもの	－	(79)	－	(79)
デリバティブ取引計	242	(183)	－	58

(*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)投資有価証券は当社が直接保有する投資信託であり、上記に含めておりません。当該投資有価証券の中間貸借対照表計上額は6,629百万円であります。
(*3)金銭の信託の信託財産のうち、投資信託は上記に含めておりません。投資信託（中間貸借対照表計上額 13,639 百万円）も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は15,986百万円であります。
(*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）時価をもって中間貸借対照表価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、上場有価証券は市場価格を用いて評価しております。当該有価証券は活発な市場で取引されているため、その時価をレベル 1 の時価に分類しております。また、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）市場価格のない非上場株式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
子会社株式	5,636

（有価証券関係）

第36期中間会計期間末（2021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）

	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	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	5,034	3,583	1,451
小計	5,034	3,583	1,451
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,595	1,611	△16
小計	1,595	1,611	△16
合計	6,629	5,195	1,434

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がないことから、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36期中間会計期間（自　2021年4月1日　至　2021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	4,614	－	△98	△98
	英ポンド	260	－	1	1
	カナダドル	81	－	△1	△1
	スイスフラン	98	－	△0	△0
	香港ドル	177	－	△3	△3
	ユーロ	497	－	△1	△1
合計		5,729	－	△103	△103

（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	19,350	－	242	242
合計		19,350	－	242	242

(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 子会社株式			
	米ドル		4,438	－	△94
	英ポンド		3,125	－	17
	カナダドル		4	－	△0
	スイスフラン		78	－	△0
	香港ドル		120	－	△2
	ユーロ		115	－	△0
	人民元		16	－	△0
合計			7,900	－	△79

(収益認識関係)

第36期中間会計期間(自　2021年4月1日　至　2021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36期中間会計期間(自　2021年4月1日　至　2021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36期中間会計期間(自　2021年4月1日　至　2021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	5,205 百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド（*）	3,454 百万円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）
第 36 期中間会計期間（自　2021 年 4 月 1 日　至　2021 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 36 期中間会計期間（自　2021 年 4 月 1 日　至　2021 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 36 期中間会計期間（自　2021 年 4 月 1 日　至　2021 年 9 月 30 日）
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

第 36 期中間会計期間 （自　2021 年 4 月 1 日 至　2021 年 9 月 30 日）
1 株当たり純資産額　20,646,304 円 65 銭 1 株当たり中間純利益　1,240,458 円 75 銭 なお、潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

（注）1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第 36 期中間会計期間 （自 2021 年 4 月 1 日 至 2021 年 9 月 30 日）
中間純利益	3,721 百万円
普通株式に係る中間純利益	3,721 百万円
普通株主に帰属しない金額	－
普通株式の期中平均株式数	3,000 株

（重要な後発事象）
該当事項はありません。

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

2022年 4月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

追加型証券投資信託
世界経済インデックスファンド
約款

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

約款第18条にもとづき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

１．基本方針

この投資信託は、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」および「新興国株式インデックス マザーファンド」の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて、国内、先進国および新興国の公社債および株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

２．運用方法

⑴投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

⑵投資態度

①主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国および新興国の公社債および株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式 50%、債券 50%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合もあります。

③各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のＧＤＰ（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

④各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年１回見直しを行う場合があります。

⑤実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。

⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引および通貨に係るオプション取引なら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、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

⑦ただし、資金動向および市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑶運用制限

①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産

の純資産総額の 60%以下とします。

②投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

３．収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、分配を行います。

(1)分配対象額の範囲

経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

(2)分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を考慮して分配金額を決定します。ただし、基準価額が下落した場合や分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

(3)留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託
世界経済インデックスファンド
約款

（信託の種類、委託者および受託者）

第1条　この信託は、証券投資信託であり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

（信託事務の委託）

第2条　受託者は、信託法第28条第1号にもとづく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第17条第1項、第17条第2項および第29条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②第1項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

（信託の目的、金額および限度額）

第3条　委託者は、金1,000,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託を行ったときは、受託者はその引受を証する書面を委託者に交付します。

③委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第4条　この信託の期間は、投資信託契約締結日から第48条第1項、第48条第2項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託終了の日または投資信託契約解約の日までとします。

（受益権の取得申込みの勧誘の種類）

第5条　この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

（当初の受益者）

第6条　この投資信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割および再分割）

第7条　委託者は、第3条第1項による受益権については1,000,000口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受託者と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。）に定めるところにしたがい、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。

（追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法）

第8条　追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じて得た金額とします。

②この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第 26 条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令およ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口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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ます。

③第28条に規定する為替予約の評価は、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るものとします。

（信託日時の異なる受益権の内容）

第9条　この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第10条　この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第 2 条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）およ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または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載また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。）。

②委託者は、この信託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また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。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③委託者は、第 7 条の規定により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または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第11条　受託者は、投資信託契約締結日に生じた受益権については投資信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

（受益権の申込単位および価額）

第 12 条　指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第 7 条第 1 項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対

し、指定販売会社が委託者の承認を得て定める申込単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。ただし、指定販売会社と別に定める自動けいぞく投資契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益者に係る収益分配金の再投資の場合は、1 円以上 1 円単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。なお、ニューヨークまたはロンドンの銀行もしくは取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 17 項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）の休業日においては、取得の申込みは受け付けないものとします。

②第 1 項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第 3 項または第 5 項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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または記録を行うことができます。

③第 1 項の受益権の価額は、この投資信託契約締結日以降は、原則として、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、第 4 項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前の取得申込みに係る当該価額は、1 口につき 1 円に、第 4 項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

④第 3 項の手数料の額は、指定販売会社が別に定めるところによるものとします。

⑤第 3 項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約にもとづいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第 37 条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

⑥第 1 項から第 5 項の規定にかかわらず、取引所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、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およ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。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第 13 条　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また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。

②第 1 項の申請のある場合には、第 1 項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、第 1 項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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③委託者は、第 1 項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載また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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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）

第 14 条　受益権の譲渡は、第 13 条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類）

第 15 条　この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 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。）
   - イ．有価証券
   - ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、投資信託約款第 21 条、第 22 条および第 23 条に定めるものに限ります。）
   - ハ．金銭債権
   - ニ．約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
   - イ．為替手形

（運用の指図範囲）

第 16 条　委託者は、信託金を主として次に掲げる第 1 号から第 6 号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）ならびに第 7 号から第 28 号までの有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. 新興国債券インデックス マザーファンド
6. 新興国株式インデックス マザーファンド
7. 株券または新株引受権証書
8. 国債証券
9. 地方債証券
10. 特別の法律により法人の発行する債券
11. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
13. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
14. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
15. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券

（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）

16. コマーシャル・ペーパー

17. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

18. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第 7 号から第 17 号の証券または証書の性質を有するもの

19. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）

20. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）

21. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）

22. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

23. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）

24. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

25. 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。）

26. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）

27. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

28. 外国の者に対する権利で第 27 号の有価証券の性質を有するもの

なお、第 7 号の証券または証書、第 18 号ならびに第 23 号の証券または証書のうち第 7 号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第 8 号から第 12 号までの証券および第 18 号ならびに第 23 号の証券または証書のうち第 8 号から第 12 号までの証券の性質を有するもの、および第 20 号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第 19 号および第 20 号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

②委託者は、信託金を、第 1 項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で第 5 号の権利の性質を有するもの

③第 1 項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を第 2 項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

④委託者は、投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マ

ザーファンドの投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の総額の100分の60を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥第4項および第5項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（利害関係人等との取引等）

第17条　受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第29条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条ならびに第16条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条から第26条まで、第28条および第32条から第34条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限にもとづいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、第15条ならびに第16条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条から第26条まで、第28条および第32条から第34条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④第1項から第3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

（運用の基本方針）

第18条　委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第19条　委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②第1項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投

資することを指図することができるものとします。

（信用取引の指図範囲）

第 20 条　委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②第 1 項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号および第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（第 5 号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

（先物取引等の運用指図、目的および範囲）

第 21 条　委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）なら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を指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

②委託者は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことを指図することができます。

③委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引なら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を指図することができます。

（スワップ取引の運用指図、目的および範囲）

第 22 条　委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。

②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第 4 条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④第 3 項においてマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

⑥委託者は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、目的および範囲）

第 23 条　委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。

②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として第 4 条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。

③金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

④第 3 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、

マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

⑥第 5 項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑦金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

⑧委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑨本条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約にもとづく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

⑩本条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日

までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

（有価証券の貸付の指図および範囲）

第24条　委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

②第1項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

（公社債の空売りの指図範囲）

第25条　委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（第26条の規定にもとづき投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことを指図することができるものとします。

②第1項の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、第2項の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

（公社債の借入れ）

第26条　委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

②第1項の指図は、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。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、第2項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、委託者はすみやかに、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。

④第1項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。

（特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）

第27条　外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

（外国為替予約の指図および範囲）

第28条　委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

②前項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（信託業務の委託等）

第 29 条　受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、第 1 項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が第 1 項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③第 1 項および第 2 項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存に係る業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（混蔵寄託）

第 30 条　金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第 2 条第 9 項に規定するものをいいます。本条においては、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含みます。）から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

（投資信託財産の登記等および記載等の留保等）

第 31 条　信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

②第 1 項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載また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また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、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算

を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（一部解約の請求および有価証券の売却等の指図）

第 32 条　委託者は、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求ならびに投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第 33 条　委託者は、第 32 条の規定によるマザーファンド受益証券の一部解約代金、有価証券の売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

（資金の借入れ）

第 34 条　委託者は、投資信託財産の効率的な運用なら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入れた資金の返済を含みます。）を目的として、また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。

②一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また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、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の 10%を超えないこととします。

③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。

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

（損益の帰属）

第 35 条　委託者の指図にもとづく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金の立替え）

第 36 条　投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②投資信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③第 1 項および第 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第 37 条　この信託の計算期間は、毎年 1 月 21 日から翌年 1 月 20 日までとすることを原則とします。ただし、第 1 計算期間は平成 21 年 1 月 16 日から平成 22 年 1 月 20 日までとします。

②第 1 項の規定にかかわらず、第 1 項の原則により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、第 4 条に定める信託期間の終了日とします。

（投資信託財産に関する報告等）

第 38 条　受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③受託者は、第 1 項および第 2 項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第 37 条第 3 項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第 37 条第 2 項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第 38 条第 1 項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第 39 条　この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1．他の受益者の氏名または名称および住所

2．他の受益者が有する受益権の内容

（信託事務の諸費用）

第 40 条　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および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、第 37 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁します。

（信託報酬等の総額および支弁の方法）

第 41 条　委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 37 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 50 の率を乗じて得た額とします。

②第 1 項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ケ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

③第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

（収益の分配方式）

第 42 条　投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1．投資信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2．売買損益に評価損益を加減して得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②第 1 項第 1 号におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの投資信託財産に係る配当等収益の額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

（収益分配金、償還金および一部解約金の支払い）

第 43 条　収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ケ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末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計算期間の末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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

②第 1 項の規定にかかわらず、別に定める契約にもとづいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、第 10 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後 1 ケ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了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、当該信託終了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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

④一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として 6 営業日目から受益者に支払います。

⑤第 1 項、第 3 項および第 4 項に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

⑥収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

⑦第 6 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、第 6 項に規定する「各受益者ごと

の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

（収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責）

第 44 条　受託者は、収益分配金については、第 43 条第 1 項に規定する支払開始日および第 43 条第 2 項に規定する交付開始前までに、償還金については第 43 条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第 43 条第 4 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、第 1 項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（収益分配金および償還金の時効）

第 45 条　受益者が、収益分配金については第 43 条第 1 項に規定する支払開始日から 5 年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第 43 条第 3 項に規定する支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（投資信託契約の一部解約）

第 46 条　受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に 1 口単位または指定販売会社が委託者の承認を得て定める解約単位をもって一部解約の実行を請求することができます。ただし、ニューヨークまたはロンドンの銀行もしくは取引所の休業日においては、当該請求には応じないものとします。

②投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

③委託者は、第 1 項の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。なお、第 1 項の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者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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

④第 3 項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に 0.1%の率を乗じて得た信託財産留保額を控除した価額とします。

⑤委託者は、取引所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、第 1 項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およ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。

⑥第 5 項により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、第 4 項の規定に準じて算出した価額とします。

（質権口記載又は記録の受益権の取り扱い）

第 47 条　振替機関等の振替口座簿の質権口に記載また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け、一部解約金および償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

（投資信託契約の解約）

第 48 条　委託者は、信託期間中において、この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とき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 5 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

③委託者は、第 1 項および第 2 項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

④第 3 項の書面決議において、受益者（委託者およ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者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

⑤第 3 項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。

⑥第 3 項から第 5 項までの規定は、委託者が投資信託契約の解約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すべ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、第 3 項から第 5 項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。

（投資信託契約に関する監督官庁の命令）

第 49 条　委託者は、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、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

②委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第 53 条の規定にしたがいます。

（委託者の登録取消等に伴う取扱い）

第 50 条　委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し信託を終了させます。

②第 1 項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 53 条第 2 項の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

（委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い）

第 51 条　委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

（受託者の辞任および解任に伴う取扱い）

第 52 条　受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第 53 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

（投資信託約款の変更等）

第 53 条　委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第 16 条第 2 号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この投資信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、第 1 項の事項（第 1 項の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）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、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

③第 2 項の書面決議において、受益者（委託者およ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者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④第 2 項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。

⑤書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第 2 項から第 5 項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等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すべ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。

⑦第 1 項から第 6 項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託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。

（反対者の買取請求権）

第 54 条　（削除）

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第 54 条の 2　委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。

この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

（公告）

第 55 条　委託者が受益者に対して行う公告は、日本経済新聞に掲載します。

（投資信託約款に関する疑義の取扱い）

第 56 条　この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 21 年 1 月 16 日

委託者　　住信アセットマネジメント株式会社

受託者　　住友信託銀行株式会社