

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年5月20日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル経済コア
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

グローバル経済コア

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

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

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

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

（６）【申込単位】

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

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

（ 7 ）【申込期間】

2022年 5月21日から2022年11月22日までとします。

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

（ 8 ）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

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

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 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

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

〔決算頻度による属性区分〕

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

〔投資対象地域による属性区分(重複使用可能)〕

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とす

る旨の記載があるものをいう。

- (4) 欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5) アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6) オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

- (1) ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4) その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

< ファンドの特色 >

1. 世界の幅広い資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 日本を含む世界*の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、債券、及び不動産投資信託証券(REIT)、並びに金に分散投資します。
※REITは新興国を含みません。
※コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。
- 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。

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

- 「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
※「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」は、金現物市場の代表的な指数への連動を目指す上場投資信託証券に投資を行うとともに、組入外貨建資産については対円での為替ヘッジを行います。株式などの主要資産が下落する局面では、金(為替ヘッジあり)にも投資することでリスクの低減を図ります。



? ファミリーファンド方式とは

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

? DR(預託証券)とは

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

2. 世界経済全体の発展を享受します。

- 株式及び債券を投資対象とする各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、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。

基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率

資産	基本資産配分比率 (変動幅) ^{*1, *2}	投資するマザーファンド	各マザーファンド受益証券の 基本組入比率 ^{*2}
株式	37.5% (35.0%~40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比（日本、先進国、新興国の比率）を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 ^{*3}
		外国株式インデックス マザーファンド	
		新興国株式インデックス マザーファンド	
債券	37.5% (35.0%~40.0%)	国内債券インデックス マザーファンド	
		外国債券インデックス マザーファンド	
		新興国債券インデックス マザーファンド	
REIT	10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5.0%
		グローバルREITインデックス マザーファンド	5.0%
金	15.0% (10.0%~20.0%)	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	基本資産配分比率で決定した比率（10.0%~20.0%）の通り。 ^{*4}

※1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。

※2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。

※3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。

※4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャルペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。

ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各資産のマザーファンド受益証券へ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※基本資産配分比率は、市場動向等に応じて変動幅の範囲で変更する場合があります。

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

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50%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。

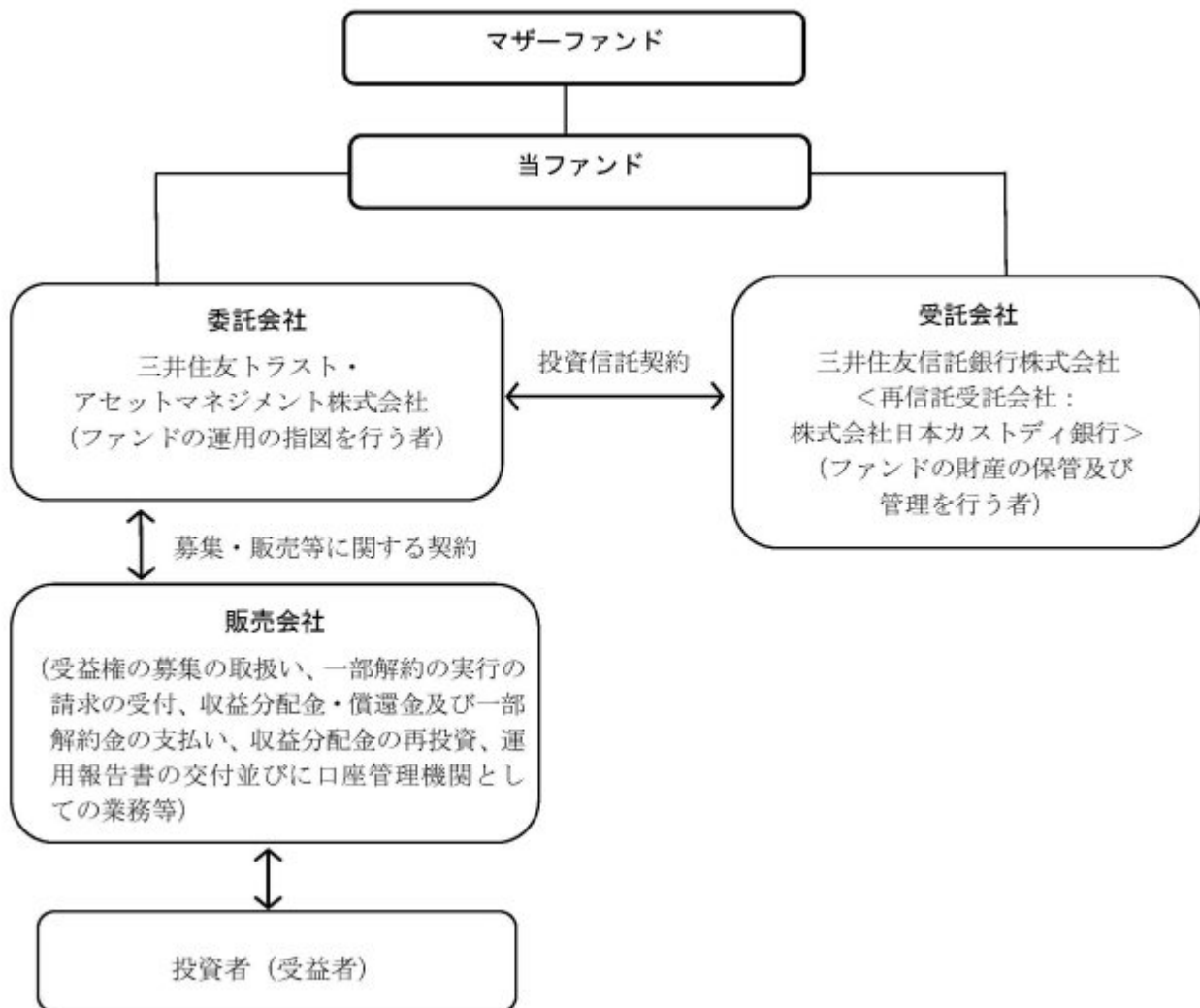
（2）【ファンドの沿革】

2017年11月30日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2022年 3月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

- | | |
|-------------|---|
| 1986年11月1日： | 住信キャピタルマネジメント株式会社設立 |
| 1987年2月20日： | 投資顧問業の登録 |
| 1987年9月9日： | 投資一任契約に係る業務の認可 |
| 1990年10月1日： | 住信投資顧問株式会社に商号変更 |
| 1999年2月15日： | 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更 |
| 1999年3月25日： | 証券投資信託委託業の認可 |
| 2007年9月30日： | 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号） |
| 2012年4月1日： | 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更 |
| 2018年10月1日： | 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継 |

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
-----	----	-----	------

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREIT インデックス マザーファンド」及び「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」（以下総称して「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。

投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券、及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）、並びに金現物市場の代表的指数への連動を目指す上場投資信託証券（以下「金」という場合があります。）に実質的に分散投資します。

REITは新興国を含みません。

ロ．基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、以下の通りとします。

基本資産配分比率 (変動幅) ^{1 2}	投資対象マザーファンド	各マザーファンド受益証券 の基本組入比率 ²
<株式> 37.5% (35.0~40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP(Gross Domestic Product(国内総生産))総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比(日本、先進国、新興国の比率)を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 ³
	外国株式インデックス マザーファンド	
	新興国株式インデックス マザーファンド	
<債券> 37.5% (35.0~40.0%)	国内債券インデックス マザーファンド	5%
	外国債券インデックス マザーファンド	
	新興国債券インデックス マザーファンド	
<REIT> 10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5%
	グローバルREITインデックス マザーファンド	5%
<金> 15.0% (10.0~20.0%)	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	基本資産配分比率で決定した比率(10.0~20.0%)の通り。 ⁴

- 1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。
 - 2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。
 - 3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。
 - 4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。
- ハ．「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ニ．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
1. 有価証券
 2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限りません。）
 3. 金銭債権
 4. 約束手形
- ロ．次に掲げる特定資産以外の資産
1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

1. 株券又は新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商

品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券

12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの

13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

（参考）マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）¹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（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場している株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「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²と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

※2 「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。

「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）³ に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

た場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

※3 「MSCI コクサイ・インデックス(円ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

「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）⁴と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

調整を行うこととします。

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

※4 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。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。

「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）⁵に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

※5 「MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）⁶に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）⁷の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

※7「東証REIT指数(配当込み)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）⁸の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

※8 「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

<別に定める金現物に投資する上場投資信託証券>（2022年 3月31日現在）

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

(2)投資態度

主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）⁹（「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。

投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。

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

3. 運用制限

株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

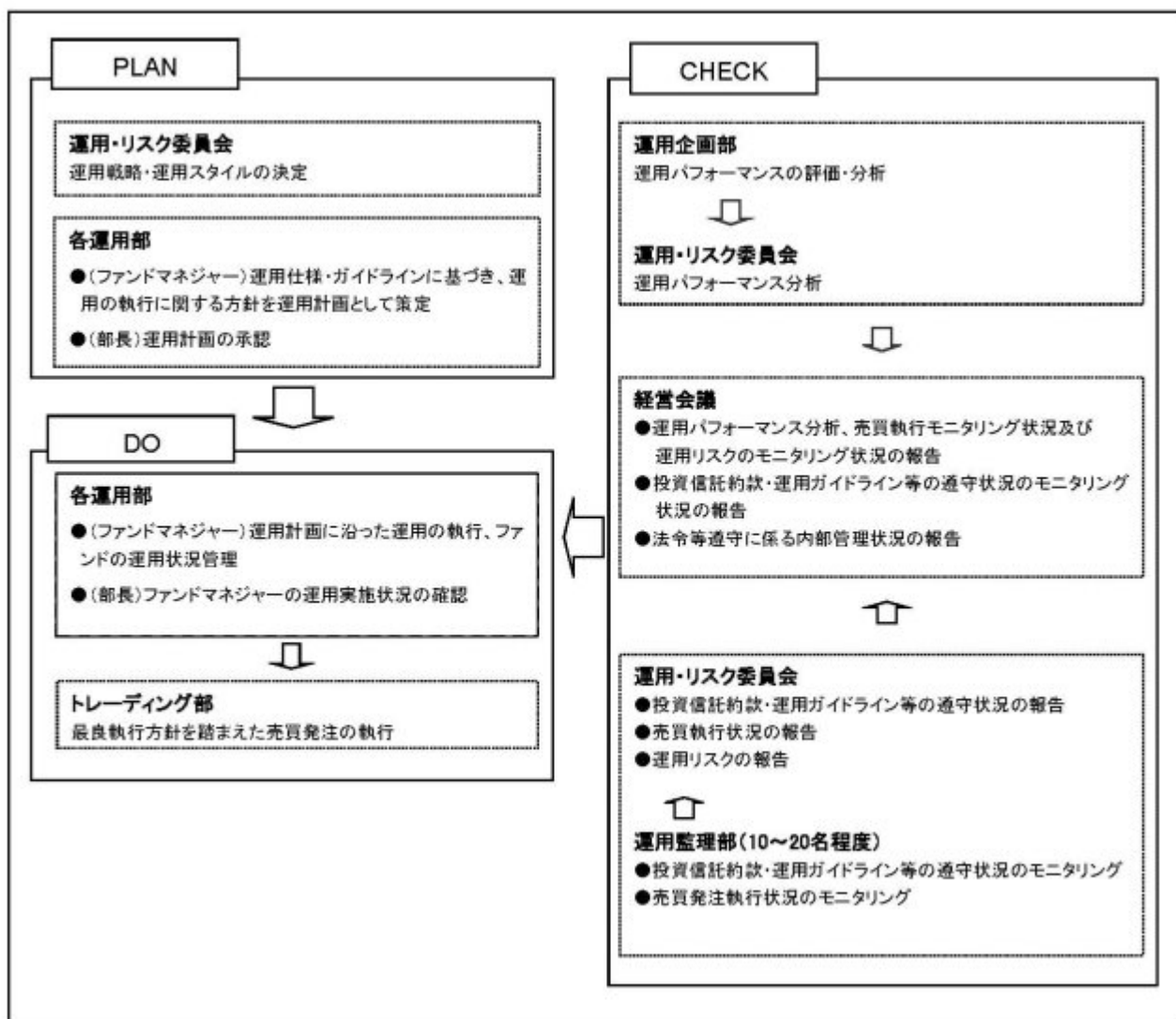
9 金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）とはLBMA金価格（円ヘッジベース）です（2022年3月31日現在）。

LBMA金価格の正式名称はLBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド

（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後公表される1トロイオンスあたりの金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会（London Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

（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．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．投資する株式等の範囲

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

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

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

めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

へ. 先物取引等の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。(以下同じ。)
- (ロ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。
- (ハ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト. スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

チ. 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

リ. 有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(八) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとしします。

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとしします。

(ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとしします。ただし、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にする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとしします。

(ニ) 上記(ロ)においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約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の買予約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為替の売予約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の売予約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。

カ．資金の借入れ

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

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

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して

円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

なお、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」における外貨建資産については、原則として為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図ることを基本としますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

金利変動リスク

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

商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

リートの価格変動リスク

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

信用リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドは中長期的な成長を目指して、市場環境等の変化や見通しに応じた運用を行うため、委託会社の判断で投資対象とする資産の投資割合を変更します。この投資割合の変更が、ファンドの収益の増加に寄与する場合がありますが、収益の減少や損失の発生の要因となる場合があります。

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

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

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落するこ

とになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*当ファンドについては2018年11月～2022年3月の3年5ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2017年4月～2022年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当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権利又は関係は、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権利又は関係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.が算出した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを測る株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当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測る株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当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測る投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。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により提供されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの募集、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、誤差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 J.P. Morgan Global Emerging Markets Bond Index (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認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 2 ）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

（ 3 ）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.935%（税抜 0.85%）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 0.44% （税抜 0.4%）	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 0.44% （税抜 0.4%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

（ 4 ）【その他の手数料等】

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

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示していません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されま（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。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

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

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」について」をご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2022年3月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2022年3月31日現在の状況について記載してあります。

【グローバル経済コア】

（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	11,020,168,587	99.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		94,285,313	0.85
合計(純資産総額)		11,114,453,900	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	637,021,180	3.9015	2,485,340,891	4.4470	2,832,833,187	25.49
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	835,472,756	3.0761	2,570,026,994	3.1088	2,597,317,703	23.37
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	349,529,744	3.4860	1,218,476,755	3.6620	1,279,977,922	11.52
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	729,220,703	1.7385	1,267,757,696	1.7543	1,279,271,879	11.51
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	851,281,432	1.2433	1,058,471,876	1.3431	1,143,356,091	10.29
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	232,434,395	2.2877	531,757,991	2.7464	638,357,822	5.74
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	239,435,761	2.2303	534,021,844	2.1659	518,593,914	4.67
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	215,832,406	1.8186	392,518,326	1.9205	414,506,135	3.73
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	227,632,518	1.4124	321,523,324	1.3880	315,953,934	2.84

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.15
合計	99.15

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2018年 8月20日)	13,643,422,697	13,643,422,697	9,632	9,632
第2期計算期間末 (2019年 8月20日)	12,745,858,008	12,745,858,008	10,021	10,021
第3期計算期間末 (2020年 8月20日)	11,044,987,442	11,044,987,442	10,880	10,880
第4期計算期間末 (2021年 8月20日)	10,716,800,292	10,716,800,292	12,281	12,281
2021年 3月末日	10,683,073,529		11,890	
4月末日	10,785,143,685		12,182	
5月末日	11,015,877,267		12,432	
6月末日	10,936,110,872		12,441	
7月末日	10,910,554,891		12,449	
8月末日	10,992,190,889		12,525	
9月末日	10,779,314,060		12,322	
10月末日	11,064,028,512		12,763	
11月末日	10,834,472,651		12,540	
12月末日	10,963,807,516		12,828	
2022年 1月末日	10,564,704,016		12,386	
2月末日	10,537,813,449		12,316	
3月末日	11,114,453,900		12,971	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	0
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	0
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	0
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	3.7
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	4.0
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	8.6

第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	12.9
第5期中間計算期間	2021年 8月21日～2022年 2月20日	1.6

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	17,310,062,925	3,145,035,108	14,165,027,817
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	3,975,335,196	5,420,865,904	12,719,497,109
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	3,287,324,947	5,855,394,358	10,151,427,698
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	1,307,931,638	2,732,701,316	8,726,658,020
第5期中間計算期間	2021年 8月21日～2022年 2月20日	632,610,776	820,357,912	8,538,910,884

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	484,011,706,440	98.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,095,985,904	1.65
合計(純資産総額)		492,107,692,344	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	7,980,650,000	1.62

(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	9,221,200	1,841.36	16,979,613,595	2,222.50	20,494,117,000	4.16
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,140,400	10,917.37	12,450,169,870	12,730.00	14,517,292,000	2.95
日本	株式	キーエンス	電気機器	165,000	54,575.10	9,004,893,048	57,250.00	9,446,250,000	1.92
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,260,500	622.31	7,007,609,821	760.30	8,561,358,150	1.74
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	115,500	49,433.29	5,709,546,054	63,250.00	7,305,375,000	1.48
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,342,000	5,725.59	7,683,751,000	5,414.00	7,265,588,000	1.48
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,868,900	2,948.65	5,510,748,812	3,545.00	6,625,250,500	1.35
日本	株式	任天堂	その他製品	102,800	66,822.09	6,869,311,106	61,670.00	6,339,676,000	1.29
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,343,600	3,138.47	4,216,849,835	4,601.00	6,181,903,600	1.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,071,200	8,076.02	8,651,036,200	5,559.00	5,954,800,800	1.21
日本	株式	信越化学工業	化学	306,100	18,836.60	5,765,885,751	18,790.00	5,751,619,000	1.17
日本	株式	日立製作所	電気機器	875,600	5,782.34	5,063,019,200	6,165.00	5,398,074,000	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,302,400	3,703.46	4,823,386,369	4,005.00	5,216,112,000	1.06
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,254,100	3,270.21	4,101,173,332	4,144.00	5,196,990,400	1.06
日本	株式	ダイキン工業	機械	231,900	21,766.68	5,047,694,205	22,410.00	5,196,879,000	1.06
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,430,900	3,694.10	5,285,891,056	3,498.00	5,005,288,200	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,433,300	3,355.99	4,810,149,677	3,487.00	4,997,917,100	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	355,200	14,485.50	5,145,251,055	14,030.00	4,983,456,000	1.01
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,242,900	3,945.09	4,903,357,112	3,907.00	4,856,010,300	0.99
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	205,600	16,645.52	3,422,319,208	23,510.00	4,833,656,000	0.98
日本	株式	三井物産	卸売業	1,392,400	2,439.66	3,396,986,358	3,328.00	4,633,907,200	0.94
日本	株式	日本電産	電気機器	471,900	12,473.00	5,886,013,150	9,748.00	4,600,081,200	0.93
日本	株式	村田製作所	電気機器	534,900	8,299.06	4,439,171,602	8,117.00	4,341,783,300	0.88
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	591,300	5,250.44	3,104,586,322	7,128.00	4,214,786,400	0.86
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	701,500	4,768.63	3,345,195,259	5,813.00	4,077,819,500	0.83
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,705,800	1,465.11	3,964,305,686	1,428.00	3,863,882,400	0.79
日本	株式	第一三共	医薬品	1,430,600	2,537.20	3,629,729,672	2,680.00	3,834,008,000	0.78
日本	株式	S M C	機械	53,300	65,820.66	3,508,241,624	68,840.00	3,669,172,000	0.75
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,296,300	1,661.73	3,815,830,696	1,567.00	3,598,302,100	0.73
日本	株式	ファナック	電気機器	159,800	26,077.36	4,167,163,396	21,645.00	3,458,871,000	0.70

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.31
		建設業	2.17
		食料品	3.19
		繊維製品	0.43
		パルプ・紙	0.20
		化学	6.34
		医薬品	4.84
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.65
		ガラス・土石製品	0.72
		鉄鋼	0.83
		非鉄金属	0.80
		金属製品	0.56
		機械	5.26
		電気機器	17.78
		輸送用機器	8.23
		精密機器	2.48
		その他製品	2.39
		電気・ガス業	1.11
		陸運業	3.03
		海運業	0.63
		空運業	0.41
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.11
		卸売業	6.00
		小売業	4.16
		銀行業	5.21
		証券、商品先物取引業	0.75
		保険業	2.20
		その他金融業	1.12
		不動産業	1.93
		サービス業	5.80
	小計	98.35	
合計		98.35	

(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	T O P I X先物	買建	410円		7,843,142,400	7,980,650,000	1.62

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	521,396,281,650	83.79
地方債証券	日本	33,466,089,471	5.38
特殊債券	日本	37,147,871,053	5.97
社債券	日本	27,241,914,220	4.38
	フランス	1,397,351,000	0.22
	オーストラリア	400,104,000	0.06
	スペイン	398,872,000	0.06
	小計	29,438,241,220	4.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		808,311,729	0.13
合計(純資産総額)		622,256,795,123	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	7,550,000,000	100.71	7,604,182,000	100.33	7,575,141,500	0.100	2024/9/20	1.22
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	100.00	6,950,000,000	0.005	2026/6/20	1.12
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	100.25	6,907,776,200	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	100.23	6,775,886,000	0.100	2023/9/20	1.09

日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	6,630,000,000	101.05	6,699,615,000	100.20	6,643,790,400	0.100	2028/3/20	1.07
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	6,560,000,000	99.09	6,500,929,400	98.95	6,491,251,200	0.100	2031/12/20	1.04
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	100.41	6,336,375,800	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	100.37	5,922,361,000	0.100	2026/9/20	0.95
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	100.41	5,844,211,200	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	100.34	5,769,952,500	0.100	2027/3/20	0.93
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	100.27	5,605,372,500	0.100	2024/3/20	0.90
日本	国債証券	第150回利付国債（5年）	5,580,000,000	99.94	5,576,824,900	99.90	5,574,699,000	0.005	2026/12/20	0.90
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,560,000,000	100.56	5,591,607,000	99.13	5,512,128,400	0.100	2031/6/20	0.89
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	101.17	5,402,584,800	0.300	2025/12/20	0.87
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	5,330,000,000	100.68	5,366,482,500	100.31	5,346,523,000	0.100	2024/6/20	0.86
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	5,250,000,000	100.88	5,296,205,100	100.03	5,251,732,500	0.100	2028/12/20	0.84
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	5,110,000,000	100.77	5,149,606,300	100.40	5,130,440,000	0.100	2025/3/20	0.82
日本	国債証券	第149回利付国債（5年）	5,130,000,000	100.42	5,151,836,600	99.95	5,127,691,500	0.005	2026/9/20	0.82
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	100.15	5,117,869,400	0.100	2028/6/20	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	100.41	5,071,008,000	0.100	2026/3/20	0.81
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	5,000,000,000	101.05	5,052,827,200	100.25	5,012,800,000	0.100	2027/12/20	0.81
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	99.45	4,863,398,400	0.100	2030/9/20	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	101.11	4,853,712,000	0.600	2023/12/20	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	101.38	4,815,787,500	0.400	2025/6/20	0.77
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	4,790,000,000	100.86	4,831,377,500	100.00	4,790,000,000	0.100	2029/3/20	0.77
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	101.29	4,618,915,200	0.400	2025/3/20	0.74
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	100.09	4,514,329,600	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	101.06	4,456,790,100	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	100.36	4,386,037,900	0.100	2024/12/20	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	83.79

地方債証券	5.38
特殊債券	5.97
社債券	4.73
合計	99.87

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	371,234,821,033	67.04
	イギリス	22,540,194,409	4.07
	カナダ	20,734,990,114	3.74
	スイス	17,717,731,961	3.20
	フランス	16,160,039,794	2.92
	ドイツ	12,844,618,963	2.32
	オーストラリア	11,434,843,941	2.07
	オランダ	9,767,879,089	1.76
	アイルランド	9,573,467,231	1.73
	スウェーデン	5,275,163,641	0.95
	デンマーク	4,226,781,873	0.76
	スペイン	3,647,765,579	0.66
	香港	3,311,703,408	0.60
	イタリア	2,742,676,560	0.50
	フィンランド	1,821,161,412	0.33
	シンガポール	1,707,302,373	0.31
	ジャージー	1,682,220,632	0.30
	ベルギー	1,340,901,899	0.24
	ノルウェー	1,210,263,265	0.22
	ケイマン	1,196,403,486	0.22
イスラエル	1,140,245,172	0.21	
バミューダ	770,986,271	0.14	
キュラソー	553,421,690	0.10	

	ルクセンブルク	487,108,418	0.09
	ニュージーランド	450,875,849	0.08
	オーストリア	318,852,585	0.06
	ポルトガル	253,959,613	0.05
	リベリア	167,206,178	0.03
	パナマ	148,973,010	0.03
	マン島	133,029,612	0.02
	ロシア	11,336,544	0.00
	小計	524,606,925,605	94.74
投資信託受益証券	オーストラリア	147,611,875	0.03
	香港	61,378,554	0.01
	小計	208,990,429	0.04
投資証券	アメリカ	10,765,484,814	1.94
	オーストラリア	774,751,018	0.14
	イギリス	333,381,666	0.06
	フランス	255,582,079	0.05
	シンガポール	232,228,889	0.04
	香港	180,396,843	0.03
	カナダ	64,864,537	0.01
	小計	12,606,689,846	2.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		16,319,078,028	2.95
合計(純資産総額)		553,741,683,908	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,503,215,798	2.08
	買建	カナダ	884,941,596	0.16
	買建	ドイツ	2,689,225,155	0.49
	買建	イギリス	229,772,640	0.04
	買建	オーストラリア	550,822,400	0.10

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		248,437,297	0.04

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,284,469	15,251.01	19,589,459,711	21,757.27	27,946,539,225	5.05
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	558,777	30,566.94	17,080,104,789	38,413.32	21,464,482,727	3.88
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	35,733	396,145.54	14,155,468,789	407,071.58	14,545,889,047	2.63
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	66,795	79,353.91	5,300,444,477	133,893.43	8,943,412,064	1.62
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	23,507	288,454.87	6,780,708,664	347,437.06	8,167,202,976	1.47
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	22,377	295,150.82	6,604,590,087	349,165.20	7,813,269,839	1.41
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	196,119	19,974.46	3,917,371,513	33,889.79	6,646,431,921	1.20
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	185,146	40,233.26	7,449,028,026	27,886.56	5,163,085,315	0.93
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,563	50,414.88	3,708,670,464	63,743.15	4,689,138,064	0.85
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	205,370	20,714.50	4,254,138,405	21,980.02	4,514,036,728	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	101,985	35,424.56	3,612,773,914	43,767.88	4,463,668,047	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	231,226	20,101.33	4,647,950,963	17,200.69	3,977,246,885	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	130,637	27,819.24	3,634,222,970	27,409.24	3,580,660,951	0.65
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	189,391	16,504.29	3,125,764,272	18,895.79	3,578,692,962	0.65
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	219,354	14,727.84	3,230,611,668	15,981.67	3,505,643,943	0.63
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	330,112	7,143.90	2,358,288,536	10,253.83	3,384,913,715	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	81,549	39,031.39	3,182,971,223	37,752.41	3,078,672,050	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	150,711	12,702.85	1,914,460,447	20,253.09	3,052,364,532	0.55
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	68,686	44,131.38	3,031,208,393	44,334.55	3,045,163,149	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	576,261	5,188.11	2,989,706,667	5,262.77	3,032,729,103	0.55

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	4,740.16	2,071,451,974	6,418.13	2,804,723,509	0.51
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	13,854.54	1,907,646,569	20,041.36	2,759,515,244	0.50
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,248	75,499.41	2,434,704,974	85,054.74	2,742,845,256	0.50
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	41,829.62	2,287,620,307	49,145.83	2,687,736,406	0.49
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	32,460	58,174.96	1,888,359,213	77,239.10	2,507,181,352	0.45
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	141,614	21,864.97	3,096,386,357	17,252.09	2,443,138,096	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	319,753	6,766.94	2,163,750,357	7,613.88	2,434,561,579	0.44
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	34,433	46,296.46	1,594,126,190	70,554.16	2,429,391,505	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	6,474.43	2,125,251,399	6,859.95	2,251,802,286	0.41
アメリカ	株式	LILLY (ELI) & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	63,296	24,446.17	1,547,345,321	35,479.63	2,245,719,110	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	4.33
		素材	4.29
		資本財	5.85
		商業・専門サービス	1.13
		運輸	2.00
		自動車・自動車部品	2.45
		耐久消費財・アパレル	1.64
		消費者サービス	1.72
		メディア・娯楽	6.20
		小売	5.03
		食品・生活必需品小売り	1.49
		食品・飲料・タバコ	3.73
		家庭用品・パーソナル用品	1.57
		ヘルスケア機器・サービス	4.67

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.00
	銀行	5.79
	各種金融	4.70
	保険	3.04
	不動産	0.43
	ソフトウェア・サービス	10.93
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.53
	電気通信サービス	1.48
	公益事業	2.88
	半導体・半導体製造装置	4.90
	小計	94.74
投資信託受益証券		0.04
投資証券		2.28
合計		97.05

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	409	アメリカドル	86,590,983	10,597,870,409	93,988,200	11,503,215,798	2.08
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	34	カナダドル	8,796,503	861,177,644	9,039,240	884,941,596	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	70	スイスフラン	8,064,490	1,068,867,505	8,456,700	1,120,851,018	0.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	297	ユーロ	10,945,259	1,496,216,905	11,473,110	1,568,374,137	0.28
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	32	オーストラリアドル	5,713,499	525,641,908	5,987,200	550,822,400	0.10
	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	1,364,916.25	219,601,375	1,428,135	229,772,640	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	売建	2,030,000.00	248,478,400	248,437,297	0.04

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	148,335,287,103	47.01
	フランス	29,971,170,544	9.50
	イタリア	26,795,533,360	8.49
	ドイツ	21,898,026,066	6.94
	スペイン	17,351,370,237	5.50
	イギリス	16,690,634,656	5.29
	ベルギー	6,705,908,788	2.13
	カナダ	6,273,626,674	1.99
	オランダ	5,628,862,694	1.78
	オーストラリア	4,962,450,394	1.57
	オーストリア	4,220,978,499	1.34
	中国	3,723,655,225	1.18
	アイルランド	2,366,839,384	0.75
	メキシコ	2,350,095,236	0.74
	フィンランド	1,818,805,447	0.58
	マレーシア	1,609,587,482	0.51
	ポーランド	1,378,807,230	0.44
	イスラエル	1,352,328,949	0.43
	デンマーク	1,294,122,571	0.41
	シンガポール	1,282,847,166	0.41
スウェーデン	870,456,190	0.28	
ノルウェー	839,321,887	0.27	
	小計	307,720,715,782	97.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,841,257,482	2.48
合計(純資産総額)		315,561,973,264	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	2,472,972,220	0.78
	買建	ドイツ	2,622,652,382	0.83

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		5,514,733,700	1.75

(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	11,285.69	1,800,068,624	10,620.20	1,693,922,072	0.625	2030/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	15,150,000	12,572.83	1,904,783,965	10,983.54	1,664,007,278	2.000	2051/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	11,747.52	1,768,002,911	11,035.17	1,660,794,540	1.125	2031/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	12,153.09	1,762,198,696	11,355.49	1,646,547,092	1.250	2028/9/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.75% 08/15/41	14,500,000	11,961.55	1,734,425,407	10,581.95	1,534,383,359	1.750	2041/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	12,240.91	1,591,318,604	11,759.00	1,528,670,223	0.250	2024/3/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	11,331.59	1,597,754,605	10,659.40	1,502,975,973	0.625	2030/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	13,230,000	11,868.39	1,570,188,912	11,210.15	1,483,104,043	1.375	2031/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/23	12,000,000	12,191.75	1,463,010,896	11,902.90	1,428,348,667	0.250	2023/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	12,680,000	11,958.18	1,516,297,231	11,106.89	1,408,353,969	1.250	2031/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	11,997.40	1,419,292,673	11,350.71	1,342,789,749	0.750	2026/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.25% 11/15/23	11,000,000	12,175.23	1,339,275,829	11,862.02	1,304,823,218	0.250	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	12,105.13	1,392,090,633	11,320.59	1,301,868,649	0.500	2026/2/28	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	12,467.31	1,390,105,097	11,508.48	1,283,196,042	1.625	2031/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	12,236.60	1,346,027,056	11,418.12	1,255,993,912	0.750	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	13,013.97	1,320,918,692	12,166.80	1,234,931,112	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,956.12	1,324,116,374	11,978.44	1,224,196,894	2.000	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	12,267.20	1,245,121,520	12,050.39	1,223,115,097	0.250	2023/4/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,517.09	1,284,155,568	10,825.77	1,207,074,243	0.875	2030/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	12,206.96	1,220,696,821	11,778.84	1,177,884,224	0.125	2024/1/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	12,174.12	1,217,412,718	11,701.15	1,170,115,335	0.250	2024/5/15	0.37

アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	11,982.22	1,223,385,252	11,274.22	1,151,098,131	1.125	2028/8/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	11,822.10	1,182,210,906	11,038.04	1,103,804,812	0.625	2027/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	13,120.11	1,174,250,061	12,117.56	1,084,522,177	2.250	2027/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,500,000	12,395.29	1,177,552,743	11,383.70	1,081,451,907	1.250	2028/6/30	0.34
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,822.42	1,161,083,332	12,740.03	1,070,162,861	3.125	2028/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	12,235.94	1,102,458,216	11,684.89	1,052,809,342	0.375	2024/7/15	0.33
フランス	国債証券	FRTR 2.75% 10/25/27	6,910,000	16,283.45	1,125,186,409	15,220.86	1,051,761,530	2.750	2027/10/25	0.33
アメリカ	国債証券	T 0.25% 06/15/24	9,000,000	12,201.79	1,098,161,409	11,674.38	1,050,694,248	0.250	2024/6/15	0.33
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	13,108.16	1,120,747,705	12,111.82	1,035,561,396	2.250	2027/8/15	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	97.52
合計	97.52

(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	65	アメリカ ドル	7,562,002.5	925,513,486	7,445,547.2	911,260,522	0.29
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	48	アメリカ ドル	5,992,478.21	733,419,408	5,886,000	720,387,540	0.23
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	46	アメリカ ドル	7,000,207.03	856,755,338	6,874,125	841,324,158	0.27
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	26	ユーロ	2,898,634.6	396,243,350	2,874,040	392,881,268	0.12
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	39	ユーロ	5,123,861.9	700,431,922	4,995,900	682,939,530	0.22
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	72	ユーロ	11,752,921.2	1,606,624,328	11,315,520	1,546,831,584	0.49

(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	22,640,000.00	2,697,267,069	2,770,230,400	0.88
	カナダドル	買建	2,180,000.00	204,283,802	213,367,500	0.07
	ユーロ	買建	16,220,000.00	2,125,504,691	2,217,517,300	0.70
	イギリスポンド	買建	1,950,000.00	303,687,927	313,618,500	0.10

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン	17,429,966,149	16.04
	台湾	16,052,827,702	14.78
	インド	13,453,328,630	12.38
	韓国	12,793,331,829	11.78
	中国	12,312,708,145	11.33
	ブラジル	5,724,008,996	5.27
	サウジアラビア	4,305,006,269	3.96
	南アフリカ	4,036,106,347	3.71
	メキシコ	2,261,714,134	2.08
	タイ	1,908,684,741	1.76
	インドネシア	1,811,036,090	1.67
	マレーシア	1,557,159,997	1.43
	アラブ首長国連邦	1,490,812,375	1.37
	香港	1,117,396,030	1.03
	カタール	1,016,237,338	0.94
	クウェート	784,929,149	0.72
	フィリピン	773,584,965	0.71
	ポーランド	748,919,538	0.69
	バミューダ	533,631,711	0.49
	チリ	491,742,343	0.45
	アメリカ	360,187,466	0.33
	ハンガリー	270,812,978	0.25
	トルコ	268,111,195	0.25
	コロンビア	238,544,499	0.22
	ギリシャ	232,195,438	0.21
	チェコ	157,965,724	0.15

	ルクセンブルク	89,881,663	0.08
	ロシア	86,667,341	0.08
	エジプト	56,525,288	0.05
	マン島	49,974,638	0.05
	オランダ	37,929,365	0.03
	シンガポール	23,190,054	0.02
	ペルー	20,534,141	0.02
	キプロス	8,084,428	0.01
	英ヴァージン諸島	1,014,552	0.00
	小計	102,504,751,248	94.35
投資信託受益証券	ブラジル	210,786,934	0.19
	メキシコ	38,109,459	0.04
	小計	248,896,393	0.23
投資証券	メキシコ	89,842,980	0.08
	南アフリカ	59,395,445	0.05
	小計	149,238,425	0.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,743,451,569	5.29
合計(純資産総額)		108,646,337,635	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,726,563,233	5.27

(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		131,977,162	0.12
	売建		2,250,586	0.00

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	2,805,389	2,616.81	7,341,189,395	2,571.35	7,213,665,059	6.64
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	655,100	7,023.87	4,601,339,260	5,952.58	3,899,537,778	3.59
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	543,916	7,149.25	3,888,593,787	7,080.87	3,851,398,487	3.54
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	1,730,088	2,417.47	4,182,451,375	1,781.39	3,081,971,843	2.84
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	326,857	4,093.25	1,337,909,313	4,356.90	1,424,086,042	1.31
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	385,346	2,838.34	1,093,743,671	3,103.43	1,195,897,612	1.10
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	466,200	4,148.63	1,934,095,791	2,503.96	1,167,348,017	1.07
ブラジル	株式	VALE SA	素材	467,987	1,736.26	812,551,024	2,458.88	1,150,725,441	1.06
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,797,620	82.02	885,713,676	90.71	979,473,705	0.90
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	198,623	4,743.18	942,105,564	3,888.28	772,302,534	0.71
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	62,753	11,099.19	696,507,678	12,257.30	769,182,347	0.71
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	小売	205,611	4,672.29	960,674,960	3,722.32	765,349,938	0.70
サウジア ラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	138,223	4,826.93	667,193,142	5,220.66	721,616,117	0.66
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	591,364	1,278.11	755,830,908	1,191.36	704,531,555	0.65
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半 導体製造装 置	173,804	4,212.50	732,150,232	3,921.32	681,541,796	0.63
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	107,803	5,719.29	616,556,924	6,082.42	655,703,824	0.60
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	1,447,248	461.68	668,171,650	452.13	654,345,396	0.60
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	727,000	881.92	641,162,497	882.09	641,283,792	0.59
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	96,421	6,686.77	644,745,403	6,432.55	620,232,904	0.57
サウジア ラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	252,104	2,191.74	552,546,627	2,345.70	591,361,865	0.54
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・ 娯楽	31,841	19,720.03	627,905,606	17,603.35	560,508,385	0.52
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・ 娯楽	235,230	2,451.34	576,630,394	2,277.18	535,661,992	0.49
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・ 娯楽	14,614	41,590.61	607,805,238	34,340.70	501,854,990	0.46
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	6,699,515	66.61	446,260,977	74.44	498,754,773	0.46
アラブ首 長国連邦	株式	EMIRATES TELECOM GROUP CO	電気通信 サービス	404,510	1,005.36	406,679,956	1,201.68	486,091,577	0.45
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信 サービス	3,658,740	114.70	419,661,809	127.75	467,417,206	0.43

ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	544,440	683.26	371,997,006	846.13	460,667,463	0.42
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	423,000	1,558.00	659,035,341	1,082.28	457,807,824	0.42
サウジアラビア	株式	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	素材	106,249	4,161.50	442,156,098	4,247.10	451,250,128	0.42
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	8,801,200	43.01	378,539,612	48.79	429,470,396	0.40

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.60
		素材	8.87
		資本財	3.11
		商業・専門サービス	0.12
		運輸	1.83
		自動車・自動車部品	3.03
		耐久消費財・アパレル	1.46
		消費者サービス	0.87
		メディア・娯楽	6.45
		小売	6.33
		食品・生活必需品小売り	1.21
		食品・飲料・タバコ	3.43
		家庭用品・パーソナル用品	0.75
		ヘルスケア機器・サービス	0.93
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.84
		銀行	15.53
		各種金融	2.49
		保険	2.69
		不動産	1.85
		ソフトウェア・サービス	2.83
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.94		
電気通信サービス	3.20		
公益事業	2.33		
半導体・半導体製造装置	9.68		
	小計	94.35	
投資信託受益証券			0.23
投資証券			0.14
合計			94.71

(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	819	アメリカドル	43,270,446	5,295,869,886	46,789,470	5,726,563,233	5.27

(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	1,078,363.61	132,065,222	131,977,162	0.12
	ブラジルリアル	売建	87,748.67	2,259,422	2,250,586	0.00

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	メキシコ	8,140,442,171	9.92
	中国	8,111,733,245	9.88
	インドネシア	8,074,994,699	9.84
	ブラジル	8,040,463,036	9.80
	タイ	7,840,622,197	9.55
	マレーシア	7,800,273,424	9.50
	南アフリカ	7,619,988,168	9.28
	ポーランド	5,511,789,772	6.72
	チェコ	3,779,057,616	4.60
	コロンビア	3,497,641,576	4.26
	ハンガリー	2,738,981,659	3.34
	ルーマニア	2,650,320,823	3.23

	ペルー	1,882,119,515	2.29
	チリ	1,755,133,681	2.14
	トルコ	740,198,311	0.90
	ウルグアイ	122,149,495	0.15
	ドミニカ共和国	121,496,902	0.15
	フィリピン	112,529,247	0.14
	小計	78,539,935,537	95.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,540,570,545	4.31
合計(純資産総額)		82,080,506,082	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	65,600,000,000	3.74	2,456,543,339	3.43	2,252,518,460	9.850	2027/6/28	2.74
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000	2,009.79	1,851,023,195	2,096.60	1,930,977,421	0.000	2024/1/1	2.35
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	70,000,000	2,123.18	1,486,226,705	2,212.62	1,548,837,975	0.000	2023/7/1	1.89
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	146,600,000	934.99	1,370,702,093	918.55	1,346,595,062	10.500	2026/12/21	1.64
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	198,300,000	582.99	1,156,078,364	560.54	1,111,562,432	5.750	2026/3/5	1.35
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	40,100,000	2,509.41	1,006,273,451	2,516.49	1,009,114,853	10.000	2023/1/1	1.23
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000	2,422.35	998,012,255	2,444.21	1,007,018,137	10.000	2027/1/1	1.23
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	122,700,000	781.66	959,108,261	773.07	948,557,185	8.000	2030/1/31	1.16
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	33,600,000,000	3.04	1,024,792,390	2.67	899,232,829	7.250	2034/10/18	1.10
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	29,800,000	2,988.90	890,692,822	2,904.94	865,672,434	3.885	2029/8/15	1.05
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	120,500,000	710.31	855,924,033	716.15	862,961,811	8.750	2048/2/28	1.05
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	144,000,000	625.16	900,232,519	591.89	852,330,645	7.500	2027/6/3	1.04
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	136,900,000	661.40	905,467,149	620.30	849,195,843	8.500	2029/5/31	1.03
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	41,850,000	1,924.18	805,272,344	1,994.76	834,809,292	0.000	2024/7/1	1.02
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000	2,451.80	779,673,789	2,476.43	787,505,383	10.000	2025/1/1	0.96
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	630.63	809,738,953	609.97	783,204,878	8.000	2024/9/5	0.95
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000	3,019.80	785,148,359	2,978.76	774,479,512	3.955	2025/9/15	0.94
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	124,600,000	633.95	789,904,454	594.00	740,126,377	7.750	2031/5/29	0.90
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	25,500,000	2,973.66	758,283,972	2,900.42	739,608,890	3.733	2028/6/15	0.90

南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	97,200,000	762.12	740,781,850	757.56	736,354,113	8.250	2032/3/31	0.90
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000	424.03	744,174,501	406.26	712,995,654	3.650	2031/6/20	0.87
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000	724.50	707,842,831	725.69	709,005,500	8.500	2037/1/31	0.86
タイ	国債証券	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000	373.50	687,255,180	369.88	680,594,454	1.450	2024/12/17	0.83
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	105,950,000	629.41	666,860,390	612.34	648,783,947	8.000	2023/12/7	0.79
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	666.38	668,047,201	638.62	640,222,960	10.000	2024/12/5	0.78
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000	2,908.59	700,970,597	2,605.81	628,001,626	2.500	2026/7/25	0.77
タイ	国債証券	THAIGB 2.875% 12/17/28	163,200,000	398.37	650,148,008	384.79	627,986,794	2.875	2028/12/17	0.77
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 01/31/44	86,000,000	712.89	613,090,751	718.22	617,675,323	8.750	2044/1/31	0.75
インドネシア	国債証券	INDOGB 7% 09/15/30	69,000,000,000	0.90	622,701,060	0.87	604,864,488	7.000	2030/9/15	0.74
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	78,000,000	766.20	597,642,646	763.98	595,904,681	8.875	2035/2/28	0.73

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.69
合計	95.69

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	112,068,097,500	96.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,134,171,618	3.56
合計(純資産総額)		116,202,269,118	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	4,124,626,000	3.55

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	11,781	705,893.39	8,316,130,040	692,000	8,152,452,000	7.02
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,106	675,734.88	6,828,976,777	639,000	6,457,734,000	5.56
日本	投資証券	G L P投資法人	32,729	183,916.1	6,019,390,090	185,400	6,067,956,600	5.22
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,534	370,025.27	6,117,997,840	356,500	5,894,371,000	5.07
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	32,679	165,633.04	5,412,722,347	161,200	5,267,854,800	4.53
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	50,988	100,928.73	5,146,154,217	103,000	5,251,764,000	4.52
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	15,173	325,118.08	4,933,016,755	328,000	4,976,744,000	4.28
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,104	358,906.09	3,626,387,212	344,500	3,480,828,000	3.00
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	20,135	180,432.48	3,633,008,055	165,300	3,328,315,500	2.86
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	22,749	141,696.85	3,223,461,774	140,700	3,200,784,300	2.75
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,905	410,281.13	2,832,991,232	399,500	2,758,547,500	2.37
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	14,346	205,391.5	2,946,546,521	184,900	2,652,575,400	2.28
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	30,675	84,704.96	2,598,324,712	80,700	2,475,472,500	2.13
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,981	584,849.21	2,328,284,709	575,000	2,289,075,000	1.97
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,126	706,894.02	2,209,750,715	731,000	2,285,106,000	1.97
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,386	449,779.62	2,422,513,055	424,000	2,283,664,000	1.97
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,489	632,792.95	2,207,814,609	640,000	2,232,960,000	1.92
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,371	189,540.92	2,344,810,766	175,200	2,167,399,200	1.87
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,814	328,645.1	2,239,387,717	317,500	2,163,445,000	1.86
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,959	65,951.24	2,041,784,569	62,300	1,928,745,700	1.66
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	44,478	42,937.87	1,909,790,697	42,200	1,876,971,600	1.62
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,543	507,260.46	1,797,223,828	507,000	1,796,301,000	1.55
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,883	154,436.59	1,835,170,062	151,100	1,795,521,300	1.55
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,884	153,951.98	1,829,565,376	151,000	1,794,484,000	1.54
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,136	728,818.26	1,556,755,815	757,000	1,616,952,000	1.39
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	13,655	112,816.28	1,540,506,312	115,100	1,571,690,500	1.35

日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,427	170,307.73	1,605,491,048	166,600	1,570,538,200	1.35
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	9,686	152,025.3	1,472,517,119	161,100	1,560,414,600	1.34
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,701	323,104.3	1,518,913,359	328,500	1,544,278,500	1.33
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	7,231	213,747.81	1,545,610,441	213,500	1,543,818,500	1.33

(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。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.44
合計	96.44

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,068	円	3,911,208,400	4,124,626,000	3.55

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	83,586,004,976	75.91
	オーストラリア	7,483,709,844	6.80
	イギリス	5,818,446,300	5.28
	シンガポール	3,760,184,833	3.41
	カナダ	2,091,822,986	1.90
	フランス	1,958,965,424	1.78
	ベルギー	1,410,247,901	1.28
	香港	1,400,197,678	1.27

	スペイン	453,446,940	0.41
	ニュージーランド	391,403,649	0.36
	ガーンジー	292,509,378	0.27
	韓国	225,566,312	0.20
	オランダ	220,690,626	0.20
	アイルランド	123,683,412	0.11
	イスラエル	86,737,212	0.08
	ドイツ	60,497,542	0.05
	イタリア	32,868,708	0.03
	小計	109,396,983,721	99.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		711,059,421	0.65
合計(純資産総額)		110,108,043,142	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		91,999,300	0.08

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	402,543	18,197.69	7,325,354,491	20,089.09	8,086,724,408	7.34
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	49,025	97,132.64	4,761,927,749	92,258.80	4,522,987,959	4.11
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	83,069	40,096.71	3,330,793,647	48,486.02	4,027,685,395	3.66
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	179,108	20,255.66	3,627,952,422	16,496.94	2,954,735,380	2.68
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	237,280	10,449.11	2,479,365,830	11,977.08	2,841,922,824	2.58
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	154,666	19,138.32	2,960,047,844	17,643.74	2,728,887,062	2.48
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	308,371	8,417.76	2,595,794,740	8,601.56	2,652,474,496	2.41
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	76,205	29,419.97	2,241,949,090	30,836.16	2,349,869,611	2.13
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	186,424	10,498.26	1,957,129,050	11,198.68	2,087,703,652	1.90
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	927,489	2,163.75	2,006,860,022	2,121.51	1,967,686,463	1.79
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	79,449	25,229.40	2,004,451,130	24,732.57	1,964,978,049	1.78

アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	72,690	24,237.39	1,761,816,029	25,573.39	1,858,929,755	1.69
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	216,784	6,466.16	1,401,760,641	7,689.76	1,667,017,734	1.51
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	62,649	24,863.47	1,557,671,764	26,070.29	1,633,277,843	1.48
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	324,163	4,961.73	1,608,411,878	5,006.97	1,623,076,005	1.47
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	35,241	41,575.02	1,465,145,407	42,679.84	1,504,080,270	1.37
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	207,021	6,927.21	1,434,078,610	7,234.47	1,497,687,814	1.36
イギリス	投資証券	SEGO PLC	653,773	2,127.47	1,390,886,457	2,188.90	1,431,049,243	1.30
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	63,064	23,615.39	1,489,281,520	21,798.88	1,374,724,751	1.25
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	292,028	4,144.48	1,210,304,932	4,262.84	1,244,869,720	1.13
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	77,348	14,413.29	1,114,839,688	16,015.95	1,238,802,118	1.13
香港	投資証券	LINK REIT	1,153,700	1,083.13	1,249,616,726	1,058.04	1,220,667,670	1.11
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	340,688	3,565.16	1,214,609,149	3,541.96	1,206,705,517	1.10
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	55,368	19,982.63	1,106,398,425	20,758.56	1,149,360,388	1.04
アメリカ	投資証券	UDR INC	161,184	6,772.31	1,091,588,260	7,101.06	1,144,578,512	1.04
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	157,081	5,808.98	912,481,295	6,787.74	1,066,226,464	0.97
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	102,741	9,405.16	966,295,741	10,065.35	1,034,124,494	0.94
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	334,107	2,852.03	952,884,394	3,059.74	1,022,283,893	0.93
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	387,230	2,235.57	865,681,395	2,439.23	944,544,078	0.86
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	92,811	10,308.83	956,772,961	9,472.98	879,197,304	0.80

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.35
合計	99.35

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	オーストラリアドル	買建	1,000,000.00	91,922,000	91,999,300	0.08

(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。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	32,463,818,770	99.90
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		33,588,126	0.10
合計（純資産総額）		32,497,406,896	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		32,299,836,320	99.39

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	7,215,695	4,224.51	30,482,839,436	4,499.05	32,463,818,770	99.90

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの


種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	263,936,932.00	30,538,045,232	32,299,836,320	99.39

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

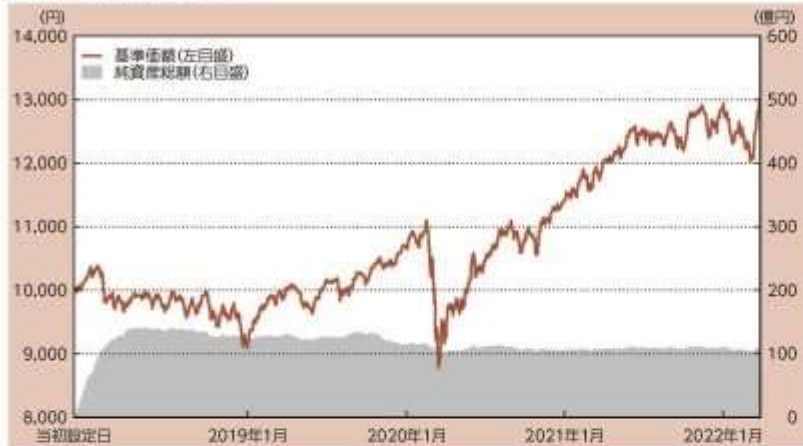
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

 当初設定日：2017年11月30日
 作成基準日：2022年3月31日

基準価額・純資産の推移


※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 12,971円

純資産総額 111.14億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年8月	0円
2019年8月	0円
2020年8月	0円
2021年8月	0円

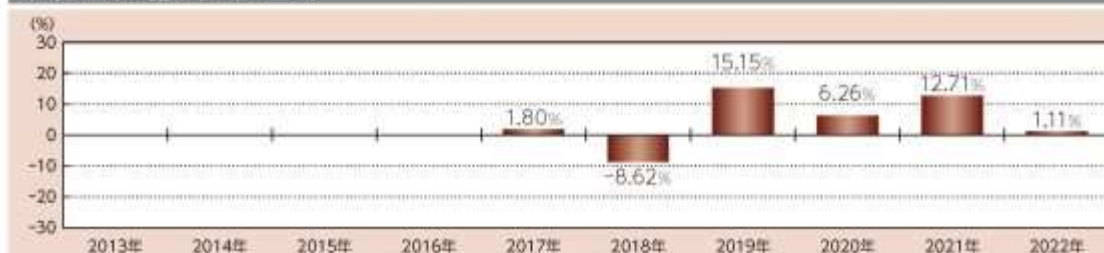
**設定来
分配金合計額** 0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種別	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	25.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェアの製造	-	-	1.3%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.0%
外国債券インデックスマザーファンド	23.4%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.1%
		T 2% 08/15/51	アメリカ	国債	-	2.000%	2051/08/15	0.1%
新興国株式インデックスマザーファンド	11.5%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.8%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.4%
新興国債券インデックスマザーファンド	11.5%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.3%
		BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	国債	-	0.000%	2024/01/01	0.3%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	10.3%	ISHARES GOLD TRUST	アメリカ	投資信託 受益証券	-	-	-	10.3%
グローバルREITインデックスマザーファンド	5.7%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.4%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.2%
J-REITインデックスマザーファンド	4.7%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.3%
		ジャパネットリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.3%
国内株式インデックスマザーファンド	3.7%	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	2.8%	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)

 ※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2022年は年初から作成基準日までの収益率です。
 ※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】
1【申込（販売）手続等】
< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2017年11月30日（設定日）から2027年 8月20日までとします。

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。

なお、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年11月30日から2018年8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）

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

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

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

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

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

(2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

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

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

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びそ

の内容を監督官庁に届け出ます。

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2020年8月21日から2021年8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。

1【財務諸表】

【グローバル経済コア】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (2020年 8月20日現在)	第4期 (2021年 8月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	136,218,018	125,888,410
親投資信託受益証券	10,922,074,855	10,651,006,807
未収入金	70,178,378	-
流動資産合計	11,128,471,251	10,776,895,217
資産合計	11,128,471,251	10,776,895,217
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,151,095	9,650,237
未払受託者報酬	2,943,437	2,949,977
未払委託者報酬	47,094,769	47,199,550
未払利息	231	225
その他未払費用	294,277	294,936
流動負債合計	83,483,809	60,094,925
負債合計	83,483,809	60,094,925
純資産の部		
元本等		
元本	10,151,427,698	8,726,658,020
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	893,559,744	1,990,142,272
(分配準備積立金)	780,557,747	1,692,183,910
元本等合計	11,044,987,442	10,716,800,292
純資産合計	11,044,987,442	10,716,800,292
負債純資産合計	11,128,471,251	10,776,895,217

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	2019年 8月21日	自	2020年 8月21日
	至	2020年 8月20日	至	2021年 8月20日
営業収益				
受取利息		567		489
有価証券売買等損益		1,127,113,231		1,395,777,839
営業収益合計		1,127,113,798		1,395,778,328
営業費用				
支払利息		66,128		49,099
受託者報酬		6,334,630		5,913,508
委託者報酬		101,353,815		94,615,898
その他費用		633,619		591,226
営業費用合計		108,388,192		101,169,731
営業利益又は営業損失（ ）		1,018,725,606		1,294,608,597
経常利益又は経常損失（ ）		1,018,725,606		1,294,608,597
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,018,725,606		1,294,608,597
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（ ）		251,567,066		185,155,316
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		26,360,899		893,559,744
剰余金増加額又は欠損金減少額		133,916,905		233,771,801
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		133,916,905		233,771,801
剰余金減少額又は欠損金増加額		33,876,600		246,642,554
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		33,876,600		246,642,554
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		893,559,744		1,990,142,272

(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3期 (2020年 8月20日現在)	第4期 (2021年 8月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	10,151,427,698口	8,726,658,020口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0880円 (10,880円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2281円 (12,281円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2019年 8月21日 至 2020年 8月20日	第4期 自 2020年 8月21日 至 2021年 8月20日																																																												
分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>199,754,456円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>377,447,638円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>115,677,802円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>203,355,653円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>896,235,549円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>10,151,427,698口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>882円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	199,754,456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	377,447,638円	収益調整金額	C	115,677,802円	分配準備積立金額	D	203,355,653円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	896,235,549円	当ファンドの期末残存口数	F	10,151,427,698口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	882円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	分配金の計算過程 <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>183,770,898円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>925,682,383円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>297,958,362円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>582,730,629円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,990,142,272円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>8,726,658,020口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,280円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	183,770,898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	925,682,383円	収益調整金額	C	297,958,362円	分配準備積立金額	D	582,730,629円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,990,142,272円	当ファンドの期末残存口数	F	8,726,658,020口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,280円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	199,754,456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	377,447,638円																																																											
収益調整金額	C	115,677,802円																																																											
分配準備積立金額	D	203,355,653円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	896,235,549円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	10,151,427,698口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	882円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	183,770,898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	925,682,383円																																																											
収益調整金額	C	297,958,362円																																																											
分配準備積立金額	D	582,730,629円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,990,142,272円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	8,726,658,020口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,280円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第4期 自 2020年 8月21日 至 2021年 8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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	第4期 (2021年 8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3期	第4期
	自 2019年 8月21日 至 2020年 8月20日	自 2020年 8月21日 至 2021年 8月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	12,719,497,109円	10,151,427,698円
期中追加設定元本額	3,287,324,947円	1,307,931,638円
期中一部解約元本額	5,855,394,358円	2,732,701,316円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第3期	第4期
	(2020年 8月20日現在)	(2021年 8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	888,053,033	1,195,580,920
合計	888,053,033	1,195,580,920

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	260,682,439	583,381,230
	グローバルREITインデックス マザーファンド	263,538,660	601,658,760
	新興国株式インデックス マザーファンド	348,986,054	1,214,052,684
	国内株式インデックス マザーファンド	235,443,632	427,683,357
	外国株式インデックス マザーファンド	668,092,981	2,602,088,542
	国内債券インデックス マザーファンド	194,594,818	275,546,262
	外国債券インデックス マザーファンド	766,604,113	2,359,760,780
	新興国債券インデックス マザーファンド	638,681,278	1,109,070,039
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	1,188,487,336	1,477,765,153
合計		4,565,111,311	10,651,006,807

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

2021年 8月20日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,682,027,722
株式	455,190,676,900
派生商品評価勘定	62,800
未収配当金	552,103,396
前払金	74,262,000
差入委託証拠金	108,225,000
流動資産合計	458,607,357,818
資産合計	458,607,357,818
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	74,384,200
未払解約金	70,968,914
未払利息	4,810
流動負債合計	145,357,924

	2021年 8月20日現在
項目	金額（円）
負債合計	145,357,924
純資産の部	
元本等	
元本	252,388,145,127
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	206,073,854,767
元本等合計	458,461,999,894
純資産合計	458,461,999,894
負債純資産合計	458,607,357,818

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		252,388,145,127口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8165円 (18,165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

	2021年 8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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8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。

	2021年 8月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月21日
期首元本額	217,825,843,779円
期中追加設定元本額	84,483,605,280円
期中一部解約元本額	49,921,303,932円
期末元本額	252,388,145,127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）	421,424,394円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,894,924,037円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,243,264円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,775,453,570円
世界経済インデックスファンド	2,979,817,349円

区分	2021年 8月20日現在
日本株式インデックス・オープン	3,469,275,498円
DCマイセレクション25	6,107,978,112円
DCマイセレクション50	18,090,751,918円
DCマイセレクション75	17,861,123,743円
DC日本株式インデックス・オープン	5,870,422,424円
DCマイセレクションS25	2,981,067,006円
DCマイセレクションS50	8,565,375,851円
DCマイセレクションS75	6,130,170,004円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,712,867,713円
DCターゲット・イヤーフンド2025	252,701,744円
DCターゲット・イヤーフンド2035	688,603,266円
DCターゲット・イヤーフンド2045	483,640,364円
DC世界経済インデックスファンド	3,282,976,662円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,549,620,720円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	6,195,294円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	26,087,128円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	20,457,639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）	190,886,745円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,358,345円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	47,356,880円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	170,540,022円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	30,528,034円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	92,853,350円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,120,681,908円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	475,027,241円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,021,513,378円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	160,593,944円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	29,298,087円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	547,201,377円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	309,423,814円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	395,325,610円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	41,816,544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）	646,281,758円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,641,067,065円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,952,531,015円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,492,806,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,088,522,067円
分散投資コア戦略ファンドA	1,412,057,804円
分散投資コア戦略ファンドS	6,014,239,060円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	416,403,500円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	392,595,694円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,016,211,335円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	209,693,652円

区分	2021年 8月20日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,464,244円
SMT インデックスバランス・オープン	59,817,253円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	26,300,419,892円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	600,614,555円
SMT 世界経済インデックス・オープン	36,767,229円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	126,776,025円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	23,130,431円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,385,823円
グローバル経済コア	235,443,632円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	23,247,900円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	64,440,784円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	18,689,652円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,205,838,610円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	145,986,412円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	4,345,998円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	3,239,980円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,472,688円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,343,421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）	42,854,058,211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）	1,154,612,326円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	201,211,744円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	30,622,688円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	541,022,593円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	46,636,133,913円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	8,021円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	58,821円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	10,266,246,578
合計	10,266,246,578

(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

（2021年 8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	株価指数先物取引 買建	3,329,257,000	-	3,254,995,000	74,262,000
合計		3,329,257,000	-	3,254,995,000	74,262,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	7,800	3,010.00	23,478,000	
日本水産	222,600	581.00	129,330,600	
マルハニチロ	37,500	2,364.00	88,650,000	
雪国まいたけ	19,700	1,532.00	30,180,400	
カネコ種苗	7,300	1,466.00	10,701,800	
サカタのタネ	28,600	3,550.00	101,530,000	
ホクト	20,100	1,927.00	38,732,700	
ホクリヨウ	3,700	696.00	2,575,200	
住石ホールディングス	42,000	128.00	5,376,000	
日鉄鉱業	5,500	6,100.00	33,550,000	
三井松島ホールディングス	10,000	1,216.00	12,160,000	
I N P E X	961,900	728.00	700,263,200	
石油資源開発	31,300	1,809.00	56,621,700	
K & O エナジーグループ	11,600	1,303.00	15,114,800	
ヒノキヤグループ	5,200	2,188.00	11,377,600	
ショーボンドホールディングス	34,200	4,925.00	168,435,000	
ミライト・ホールディングス	83,100	2,072.00	172,183,200	
タマホーム	14,500	2,333.00	33,828,500	
サンヨーホームズ	2,800	708.00	1,982,400	
日本アクア	9,500	526.00	4,997,000	
ファーストコーポレーション	7,300	738.00	5,387,400	
ベステラ	4,600	1,356.00	6,237,600	
Robot Home	40,000	191.00	7,640,000	
キャンディル	4,100	588.00	2,410,800	

スペースバリューホールディングス	29,200	794.00	23,184,800	
ダイセキ環境ソリューション	4,600	1,121.00	5,156,600	
第一カッター興業	5,900	1,263.00	7,451,700	
安藤・間	153,700	813.00	124,958,100	
東急建設	70,200	730.00	51,246,000	
コムシスホールディングス	85,000	2,963.00	251,855,000	
ビーアールホールディングス	32,100	476.00	15,279,600	
高松コンストラクショングループ	14,900	2,023.00	30,142,700	
東建コーポレーション	7,400	9,670.00	71,558,000	
ソネック	2,500	1,104.00	2,760,000	
ヤマウラ	10,400	927.00	9,640,800	
オリエンタル白石	80,600	270.00	21,762,000	
大成建設	172,300	3,565.00	614,249,500	
大林組	553,700	914.00	506,081,800	
清水建設	518,700	824.00	427,408,800	
飛島建設	15,900	1,058.00	16,822,200	
長谷工コーポレーション	181,400	1,456.00	264,118,400	
松井建設	21,800	744.00	16,219,200	
銭高組	2,400	3,965.00	9,516,000	
鹿島建設	405,700	1,409.00	571,631,300	
不動テトラ	13,600	1,681.00	22,861,600	
大末建設	7,000	961.00	6,727,000	
鉄建建設	11,200	1,795.00	20,104,000	
西松建設	39,600	3,315.00	131,274,000	
三井住友建設	133,800	467.00	62,484,600	
大豊建設	12,100	4,040.00	48,884,000	
前田建設工業	138,700	785.00	108,879,500	
佐田建設	12,800	480.00	6,144,000	
ナカノフドー建設	13,200	336.00	4,435,200	
奥村組	30,400	2,940.00	89,376,000	
東鉄工業	23,700	2,419.00	57,330,300	
イチケン	4,000	1,897.00	7,588,000	
富士ピー・エス	7,100	560.00	3,976,000	
浅沼組	6,600	4,370.00	28,842,000	
戸田建設	229,900	780.00	179,322,000	
熊谷組	25,700	2,669.00	68,593,300	
北野建設	3,400	2,220.00	7,548,000	
植木組	4,900	1,475.00	7,227,500	
矢作建設工業	24,500	711.00	17,419,500	
ピーエス三菱	18,200	623.00	11,338,600	
日本ハウスホールディングス	37,800	400.00	15,120,000	
大東建託	60,400	12,330.00	744,732,000	

新日本建設	23,500	845.00	19,857,500
N I P P O	45,800	3,045.00	139,461,000
東亜道路工業	3,400	4,435.00	15,079,000
前田道路	34,200	1,785.00	61,047,000
日本道路	5,400	7,990.00	43,146,000
東亜建設工業	14,800	2,264.00	33,507,200
日本国土開発	53,900	565.00	30,453,500
若築建設	9,900	1,787.00	17,691,300
東洋建設	62,100	533.00	33,099,300
五洋建設	235,200	694.00	163,228,800
世紀東急工業	26,600	819.00	21,785,400
福田組	5,900	4,770.00	28,143,000
住友林業	141,700	1,947.00	275,889,900
日本基礎技術	16,900	561.00	9,480,900
巴コーポレーション	24,600	387.00	9,520,200
大和ハウス工業	511,300	3,314.00	1,694,448,200
ライト工業	31,700	1,885.00	59,754,500
積水ハウス	600,500	2,132.50	1,280,566,250
日特建設	13,700	711.00	9,740,700
北陸電気工事	9,600	1,273.00	12,220,800
ユアテック	31,700	687.00	21,777,900
日本リーテック	11,600	1,581.00	18,339,600
四電工	3,000	3,180.00	9,540,000
中電工	25,500	2,227.00	56,788,500
関電工	90,000	918.00	82,620,000
きんでん	112,500	1,813.00	203,962,500
東京エネシス	18,400	981.00	18,050,400
トーエネック	5,600	3,620.00	20,272,000
住友電設	15,600	2,065.00	32,214,000
日本電設工業	30,400	1,812.00	55,084,800
協和エクシオ	84,000	2,665.00	223,860,000
新日本空調	14,600	2,265.00	33,069,000
九電工	38,800	3,850.00	149,380,000
三機工業	39,200	1,472.00	57,702,400
日揮ホールディングス	184,700	892.00	164,752,400
中外炉工業	6,000	1,747.00	10,482,000
ヤマト	17,700	741.00	13,115,700
太平電業	12,300	2,645.00	32,533,500
高砂熱学工業	50,100	2,017.00	101,051,700
三晃金属工業	2,200	2,118.00	4,659,600
朝日工業社	4,100	3,270.00	13,407,000
明星工業	35,800	743.00	26,599,400

大気社	26,900	3,355.00	90,249,500
ダイダン	12,300	2,637.00	32,435,100
日比谷総合設備	17,800	1,878.00	33,428,400
フィル・カンパニー	3,200	2,707.00	8,662,400
テスホールディングス	10,100	1,979.00	19,987,900
東洋エンジニアリング	23,300	927.00	21,599,100
レイズネクスト	29,700	1,083.00	32,165,100
ニッポン	51,900	1,649.00	85,583,100
日清製粉グループ本社	200,200	1,799.00	360,159,800
日東富士製粉	1,300	6,610.00	8,593,000
昭和産業	15,400	2,824.00	43,489,600
鳥越製粉	15,700	775.00	12,167,500
中部飼料	21,600	1,116.00	24,105,600
フィード・ワン	23,800	733.00	17,445,400
東洋精糖	3,000	1,176.00	3,528,000
日本甜菜製糖	9,200	1,629.00	14,986,800
D M三井製糖ホールディングス	14,000	1,939.00	27,146,000
塩水港精糖	21,100	219.00	4,620,900
日新製糖	8,400	1,682.00	14,128,800
森永製菓	41,600	3,915.00	162,864,000
中村屋	4,300	3,750.00	16,125,000
江崎グリコ	48,800	4,250.00	207,400,000
名糖産業	7,800	1,662.00	12,963,600
井村屋グループ	10,000	2,282.00	22,820,000
不二家	9,900	2,256.00	22,334,400
山崎製パン	132,800	1,781.00	236,516,800
第一屋製パン	3,400	858.00	2,917,200
モロゾフ	2,800	5,390.00	15,092,000
亀田製菓	10,100	4,675.00	47,217,500
寿スピリッツ	17,100	6,200.00	106,020,000
カルビー	80,800	2,667.00	215,493,600
森永乳業	32,800	7,060.00	231,568,000
六甲バター	12,900	1,541.00	19,878,900
ヤクルト本社	121,900	6,310.00	769,189,000
明治ホールディングス	117,200	6,810.00	798,132,000
雪印メグミルク	42,700	2,323.00	99,192,100
プリマハム	24,900	2,920.00	72,708,000
日本ハム	67,700	4,220.00	285,694,000
林兼産業	5,900	570.00	3,363,000
丸大食品	17,400	1,746.00	30,380,400
S Foods	15,900	3,180.00	50,562,000
柿安本店	6,100	2,491.00	15,195,100

伊藤ハム米久ホールディングス	114,100	743.00	84,776,300
サッポロホールディングス	60,500	2,325.00	140,662,500
アサヒグループホールディングス	416,900	4,925.00	2,053,232,500
麒麟ホールディングス	651,300	1,982.00	1,290,876,600
宝ホールディングス	131,400	1,352.00	177,652,800
オエノンホールディングス	50,300	373.00	18,761,900
養命酒製造	5,400	1,793.00	9,682,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	124,400	1,550.00	192,820,000
サントリー食品インターナショナル	118,600	4,300.00	509,980,000
ダイトーグループホールディングス	10,000	5,510.00	55,100,000
伊藤園	53,800	6,870.00	369,606,000
キーコーヒー	17,400	2,183.00	37,984,200
ユニカフェ	5,300	995.00	5,273,500
ジャパンフーズ	2,500	1,223.00	3,057,500
日清オイリオグループ	22,200	3,050.00	67,710,000
不二製油グループ本社	43,200	2,449.00	105,796,800
かどや製油	1,900	3,945.00	7,495,500
J - オイルミルズ	16,500	1,805.00	29,782,500
キッコーマン	127,500	7,270.00	926,925,000
味の素	421,400	3,102.00	1,307,182,800
ブルドックソース	8,000	1,992.00	15,936,000
キューピー	98,700	2,597.00	256,323,900
ハウス食品グループ本社	66,300	3,430.00	227,409,000
カゴメ	67,200	2,948.00	198,105,600
焼津水産化学工業	8,600	959.00	8,247,400
アリアケジャパン	16,200	6,110.00	98,982,000
ピエトロ	2,300	1,733.00	3,985,900
エバラ食品工業	3,900	2,553.00	9,956,700
やまみ	1,900	1,930.00	3,667,000
ニチレイ	84,400	2,614.00	220,621,600
東洋水産	91,200	4,490.00	409,488,000
イトアンドホールディングス	6,100	2,098.00	12,797,800
大冷	2,000	1,977.00	3,954,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,900	730.00	7,227,000
日清食品ホールディングス	69,500	8,470.00	588,665,000
永谷園ホールディングス	8,700	2,094.00	18,217,800
一正蒲鉾	6,900	911.00	6,285,900
フジッコ	19,200	1,900.00	36,480,000
ロック・フィールド	19,100	1,491.00	28,478,100
日本たばこ産業	950,200	2,118.50	2,012,998,700
ケンコーマヨネーズ	10,800	1,501.00	16,210,800
わらべや日洋ホールディングス	11,600	2,114.00	24,522,400

なとり	9,900	1,952.00	19,324,800
イフジ産業	2,700	943.00	2,546,100
ピクルスコーポレーション	4,200	3,545.00	14,889,000
ファーマフーズ	16,700	2,671.00	44,605,700
北の達人コーポレーション	61,900	507.00	31,383,300
ユーグレナ	90,200	889.00	80,187,800
紀文食品	10,300	1,228.00	12,648,400
ミヨシ油脂	6,800	1,251.00	8,506,800
理研ビタミン	16,700	1,702.00	28,423,400
片倉工業	19,600	1,453.00	28,478,800
ゲンゼ	12,800	4,315.00	55,232,000
東洋紡	68,700	1,336.00	91,783,200
ユニチカ	52,100	323.00	16,828,300
富士紡ホールディングス	8,500	4,020.00	34,170,000
倉敷紡績	15,000	1,882.00	28,230,000
シキボウ	9,700	910.00	8,827,000
日本毛織	52,600	972.00	51,127,200
トーア紡コーポレーション	6,400	421.00	2,694,400
帝国繊維	19,800	1,890.00	37,422,000
帝人	163,100	1,588.00	259,002,800
東レ	1,252,700	714.50	895,054,150
サカイオーベックス	4,700	3,805.00	17,883,500
住江織物	3,800	1,828.00	6,946,400
日本フェルト	10,900	448.00	4,883,200
イチカワ	2,600	1,321.00	3,434,600
日東製網	1,900	1,472.00	2,796,800
アツギ	13,600	623.00	8,472,800
ダイニック	6,500	721.00	4,686,500
セーレン	42,800	1,970.00	84,316,000
ソトー	7,100	792.00	5,623,200
東海染工	2,400	1,126.00	2,702,400
小松マテーレ	28,600	918.00	26,254,800
ワコールホールディングス	43,200	2,246.00	97,027,200
ホギメディカル	23,400	3,480.00	81,432,000
T S Iホールディングス	53,100	291.00	15,452,100
マツオカコーポレーション	5,700	1,440.00	8,208,000
ワールド	22,800	1,313.00	29,936,400
三陽商会	9,000	801.00	7,209,000
ナイガイ	7,000	335.00	2,345,000
オンワードホールディングス	104,600	270.00	28,242,000
ルックホールディングス	5,700	1,228.00	6,999,600
ゴールドウイン	28,600	6,410.00	183,326,000

デサント	29,600	3,125.00	92,500,000
キング	9,700	508.00	4,927,600
ヤマトインターナショナル	15,800	332.00	5,245,600
特種東海製紙	10,600	4,470.00	47,382,000
王子ホールディングス	778,500	588.00	457,758,000
日本製紙	76,500	1,265.00	96,772,500
三菱製紙	24,500	348.00	8,526,000
北越コーポレーション	123,700	561.00	69,395,700
中越パルプ工業	6,600	1,185.00	7,821,000
巴川製紙所	5,700	857.00	4,884,900
大王製紙	83,400	2,003.00	167,050,200
阿波製紙	4,500	388.00	1,746,000
レンゴー	178,300	904.00	161,183,200
トモク	10,600	1,833.00	19,429,800
ザ・パック	13,100	2,890.00	37,859,000
クラレ	252,900	1,014.00	256,440,600
旭化成	1,146,200	1,121.50	1,285,463,300
共和レザー	9,400	663.00	6,232,200
昭和電工	123,100	2,737.00	336,924,700
住友化学	1,361,200	529.00	720,074,800
住友精化	8,400	3,450.00	28,980,000
日産化学	94,700	5,940.00	562,518,000
ラサ工業	5,700	1,741.00	9,923,700
クレハ	14,800	7,150.00	105,820,000
多木化学	6,700	6,060.00	40,602,000
テイカ	12,700	1,264.00	16,052,800
石原産業	31,000	1,063.00	32,953,000
片倉コープアグリ	4,500	1,186.00	5,337,000
日本曹達	24,200	3,385.00	81,917,000
東ソー	267,300	1,920.00	513,216,000
トクヤマ	51,400	2,142.00	110,098,800
セントラル硝子	33,000	2,134.00	70,422,000
東亜合成	98,500	1,199.00	118,101,500
大阪ソーダ	17,600	2,556.00	44,985,600
関東電化工業	41,000	994.00	40,754,000
デンカ	63,100	3,575.00	225,582,500
信越化学工業	319,800	17,590.00	5,625,282,000
日本カーバイド工業	6,400	1,269.00	8,121,600
堺化学工業	12,100	1,992.00	24,103,200
第一稀元素化学工業	17,400	1,555.00	27,057,000
エア・ウォーター	176,300	1,762.00	310,640,600
日本酸素ホールディングス	142,400	2,468.00	351,443,200

日本化学工業	4,900	3,120.00	15,288,000
東邦アセチレン	2,600	1,232.00	3,203,200
日本パーカライジング	87,200	1,116.00	97,315,200
高压ガス工業	27,400	742.00	20,330,800
チタン工業	2,200	1,683.00	3,702,600
四国化成工業	22,500	1,274.00	28,665,000
戸田工業	3,700	2,844.00	10,522,800
ステラ ケミファ	9,400	2,648.00	24,891,200
保土谷化学工業	5,100	4,350.00	22,185,000
日本触媒	31,300	5,580.00	174,654,000
大日精化工業	14,300	2,361.00	33,762,300
カネカ	44,700	4,175.00	186,622,500
三菱瓦斯化学	173,200	1,970.00	341,204,000
三井化学	149,300	3,495.00	521,803,500
J S R	173,500	3,520.00	610,720,000
東京応化工業	29,700	6,560.00	194,832,000
大阪有機化学工業	14,700	3,390.00	49,833,000
三菱ケミカルホールディングス	1,156,000	898.80	1,039,012,800
K Hネオケム	28,500	2,725.00	77,662,500
ダイセル	232,500	852.00	198,090,000
住友ベークライト	27,200	4,540.00	123,488,000
積水化学工業	361,800	1,819.00	658,114,200
日本ゼオン	155,900	1,431.00	223,092,900
アイカ工業	48,200	3,615.00	174,243,000
宇部興産	87,300	2,170.00	189,441,000
積水樹脂	26,100	2,101.00	54,836,100
タキロンシーアイ	37,400	599.00	22,402,600
旭有機材	9,800	1,403.00	13,749,400
ニチバン	9,100	1,776.00	16,161,600
リケンテクノス	42,200	553.00	23,336,600
大倉工業	8,800	2,169.00	19,087,200
積水化成品工業	23,200	575.00	13,340,000
群栄化学工業	3,900	2,530.00	9,867,000
タイガースポリマー	9,100	429.00	3,903,900
ミライアル	5,500	1,208.00	6,644,000
ダイキアクシス	6,600	827.00	5,458,200
ダイキョーニシカワ	36,500	641.00	23,396,500
竹本容器	6,200	900.00	5,580,000
森六ホールディングス	9,300	2,078.00	19,325,400
恵和	4,300	4,215.00	18,124,500
日本化薬	107,000	1,189.00	127,223,000
カーリットホールディングス	17,100	791.00	13,526,100

日本精化	12,500	1,923.00	24,037,500
扶桑化学工業	13,600	4,170.00	56,712,000
トリケミカル研究所	16,000	3,100.00	49,600,000
A D E K A	79,600	2,197.00	174,881,200
日油	65,100	5,930.00	386,043,000
新日本理化	28,600	259.00	7,407,400
ハリマ化成グループ	12,900	879.00	11,339,100
花王	390,600	6,719.00	2,624,441,400
第一工業製薬	5,900	3,135.00	18,496,500
石原ケミカル	4,400	2,648.00	11,651,200
日華化学	5,800	1,020.00	5,916,000
ニイタカ	3,600	2,063.00	7,426,800
三洋化成工業	10,300	5,760.00	59,328,000
有機合成薬品工業	13,200	311.00	4,105,200
大日本塗料	19,500	847.00	16,516,500
日本ペイントホールディングス	649,700	1,370.00	890,089,000
関西ペイント	194,300	2,785.00	541,125,500
神東塗料	13,600	188.00	2,556,800
中国塗料	41,600	894.00	37,190,400
日本特殊塗料	12,900	1,007.00	12,990,300
藤倉化成	23,300	515.00	11,999,500
太陽ホールディングス	12,700	5,710.00	72,517,000
D I C	73,000	3,025.00	220,825,000
サカタインクス	34,300	1,090.00	37,387,000
東洋インキ S C ホールディングス	36,600	1,991.00	72,870,600
T & K T O K A	12,100	766.00	9,268,600
富士フイルムホールディングス	310,300	8,717.00	2,704,885,100
資生堂	328,900	6,756.00	2,222,048,400
ライオン	213,200	1,858.00	396,125,600
高砂香料工業	11,000	2,702.00	29,722,000
マンダム	37,000	1,598.00	59,126,000
ミルボン	21,800	6,280.00	136,904,000
ファンケル	64,300	3,530.00	226,979,000
コーセー	33,200	13,060.00	433,592,000
コタ	11,200	1,555.00	17,416,000
シーボン	2,300	1,870.00	4,301,000
ポーラ・オルビスホールディングス	75,400	2,338.00	176,285,200
ノエビアホールディングス	15,000	5,630.00	84,450,000
アジュバンコスメジャパン	3,900	1,043.00	4,067,700
新日本製薬	4,800	1,762.00	8,457,600
エステー	11,300	1,730.00	19,549,000
アグロ カネショウ	5,900	1,362.00	8,035,800

コニシ	29,000	1,670.00	48,430,000
長谷川香料	30,400	2,700.00	82,080,000
星光P M C	10,100	832.00	8,403,200
小林製薬	49,500	8,470.00	419,265,000
荒川化学工業	14,700	1,205.00	17,713,500
メック	13,200	3,035.00	40,062,000
日本高純度化学	4,800	2,818.00	13,526,400
タカラバイオ	46,200	3,040.00	140,448,000
J C U	19,900	3,840.00	76,416,000
新田ゼラチン	11,100	624.00	6,926,400
O A T アグリオ	3,600	1,569.00	5,648,400
デクセリアルズ	49,400	2,035.00	100,529,000
アース製薬	14,500	6,440.00	93,380,000
北興化学工業	16,400	989.00	16,219,600
大成ラミック	5,400	2,787.00	15,049,800
クミアイ化学工業	65,700	879.00	57,750,300
日本農薬	31,500	529.00	16,663,500
アキレス	12,200	1,321.00	16,116,200
有沢製作所	24,600	878.00	21,598,800
日東電工	106,700	8,230.00	878,141,000
レック	20,900	1,079.00	22,551,100
三光合成	18,500	418.00	7,733,000
きもと	27,000	225.00	6,075,000
藤森工業	15,800	4,265.00	67,387,000
前澤化成工業	11,200	1,233.00	13,809,600
未来工業	6,300	1,639.00	10,325,700
ウェーブロックホールディングス	6,100	658.00	4,013,800
J S P	10,300	1,552.00	15,985,600
エフピコ	32,500	4,265.00	138,612,500
天馬	13,200	2,620.00	34,584,000
信越ポリマー	27,200	950.00	25,840,000
東リ	44,000	232.00	10,208,000
ニフコ	64,800	3,270.00	211,896,000
バルカー	14,300	2,077.00	29,701,100
ユニ・チャーム	340,300	4,820.00	1,640,246,000
ショーエイコーポレーション	3,900	734.00	2,862,600
協和キリン	207,200	3,590.00	743,848,000
武田薬品工業	1,468,900	3,658.00	5,373,236,200
アステラス製薬	1,530,800	1,845.00	2,824,326,000
大日本住友製薬	130,900	1,898.00	248,448,200
塩野義製薬	222,000	6,803.00	1,510,266,000
わかもと製薬	21,000	336.00	7,056,000

日本新薬	50,100	8,700.00	435,870,000
中外製薬	552,200	4,284.00	2,365,624,800
科研製薬	30,200	5,170.00	156,134,000
エーザイ	195,100	9,101.00	1,775,605,100
ロート製薬	84,200	3,315.00	279,123,000
小野薬品工業	405,500	2,594.50	1,052,069,750
久光製薬	51,400	4,460.00	229,244,000
持田製薬	24,500	3,545.00	86,852,500
参天製薬	307,300	1,589.00	488,299,700
扶桑薬品工業	5,700	2,364.00	13,474,800
日本ケミファ	2,100	2,206.00	4,632,600
ツムラ	58,900	3,760.00	221,464,000
日医工	50,000	910.00	45,500,000
キッセイ薬品工業	31,200	2,375.00	74,100,000
生化学工業	31,100	1,102.00	34,272,200
栄研化学	31,000	2,101.00	65,131,000
日水製薬	6,500	992.00	6,448,000
鳥居薬品	9,500	2,801.00	26,609,500
JCRファーマ	49,800	3,030.00	150,894,000
東和薬品	25,400	2,978.00	75,641,200
富士製薬工業	10,900	1,115.00	12,153,500
ゼリア新薬工業	32,000	2,136.00	68,352,000
第一三共	1,387,500	2,516.00	3,490,950,000
キョーリン製薬ホールディングス	39,000	1,833.00	71,487,000
大幸薬品	26,600	892.00	23,727,200
ダイト	11,300	3,420.00	38,646,000
大塚ホールディングス	366,900	4,726.00	1,733,969,400
大正製薬ホールディングス	43,500	6,240.00	271,440,000
ペプチドリーム	92,600	3,960.00	366,696,000
あすか製薬ホールディングス	20,100	974.00	19,577,400
サワイグループホールディングス	38,700	4,950.00	191,565,000
日本コークス工業	149,200	111.00	16,561,200
ニチレキ	20,800	1,219.00	25,355,200
ユシロ化学工業	9,900	1,163.00	11,513,700
ビーピー・カストロール	6,300	1,333.00	8,397,900
富士石油	42,900	235.00	10,081,500
MORESCO	6,400	1,133.00	7,251,200
出光興産	195,900	2,546.00	498,761,400
ENEOSホールディングス	2,656,100	416.30	1,105,734,430
コスモエネルギーホールディングス	55,800	2,107.00	117,570,600
横浜ゴム	102,200	1,909.00	195,099,800
TOYO TIRE	92,900	1,899.00	176,417,100

ブリヂストン	508,600	4,891.00	2,487,562,600
住友ゴム工業	158,600	1,323.00	209,827,800
藤倉コンポジット	15,400	579.00	8,916,600
オカモト	10,500	4,080.00	42,840,000
フコク	7,700	953.00	7,338,100
ニッタ	18,300	2,608.00	47,726,400
住友理工	34,200	672.00	22,982,400
三ツ星ベルト	21,400	1,950.00	41,730,000
バンドー化学	31,100	855.00	26,590,500
日東紡績	26,300	3,140.00	82,582,000
A G C	162,100	4,860.00	787,806,000
日本板硝子	89,600	543.00	48,652,800
石塚硝子	3,000	1,963.00	5,889,000
日本山村硝子	7,400	910.00	6,734,000
日本電気硝子	71,000	2,305.00	163,655,000
オハラ	7,000	1,256.00	8,792,000
住友大阪セメント	31,800	2,977.00	94,668,600
太平洋セメント	100,300	2,473.00	248,041,900
日本ヒューム	16,200	729.00	11,809,800
日本コンクリート工業	38,300	290.00	11,107,000
三谷セキサン	8,200	5,010.00	41,082,000
アジアパイルホールディングス	27,300	482.00	13,158,600
東海カーボン	148,000	1,359.00	201,132,000
日本カーボン	9,100	3,985.00	36,263,500
東洋炭素	11,500	2,624.00	30,176,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,800	3,890.00	38,122,000
T O T O	126,100	5,930.00	747,773,000
日本碍子	194,300	1,721.00	334,390,300
日本特殊陶業	134,400	1,597.00	214,636,800
M A R U W A	6,100	10,160.00	61,976,000
品川リフラクトリーズ	4,200	3,685.00	15,477,000
黒崎播磨	3,000	4,640.00	13,920,000
ヨータイ	12,700	1,230.00	15,621,000
イソライト工業	7,900	647.00	5,111,300
東京窯業	22,700	322.00	7,309,400
ニッカトー	8,100	677.00	5,483,700
フジインコーポレーテッド	14,200	5,590.00	79,378,000
クニミネ工業	5,600	1,080.00	6,048,000
エーアンドエーマテリアル	3,400	991.00	3,369,400
ニチアス	44,600	2,722.00	121,401,200
ニチハ	24,600	2,826.00	69,519,600
日本製鉄	833,500	1,902.50	1,585,733,750

神戸製鋼所	319,700	645.00	206,206,500
中山製鋼所	24,400	410.00	10,004,000
合同製鐵	9,500	1,449.00	13,765,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	505,300	1,441.00	728,137,300
東京製鐵	68,100	1,063.00	72,390,300
共英製鋼	19,700	1,358.00	26,752,600
大和工業	37,100	3,775.00	140,052,500
東京鐵鋼	6,700	1,502.00	10,063,400
大阪製鐵	9,300	1,123.00	10,443,900
淀川製鋼所	23,000	2,299.00	52,877,000
丸一鋼管	56,700	2,617.00	148,383,900
モリ工業	5,200	2,295.00	11,934,000
大同特殊鋼	28,600	4,740.00	135,564,000
日本高周波鋼業	6,600	385.00	2,541,000
日本冶金工業	13,600	2,468.00	33,564,800
山陽特殊製鋼	21,000	1,623.00	34,083,000
愛知製鋼	9,800	2,651.00	25,979,800
日立金属	164,600	2,122.00	349,281,200
日本金属	4,400	933.00	4,105,200
大平洋金属	11,900	1,539.00	18,314,100
新日本電工	112,900	296.00	33,418,400
栗本鐵工所	7,900	1,604.00	12,671,600
虹技	2,500	1,106.00	2,765,000
三菱製鋼	13,000	1,120.00	14,560,000
日亜鋼業	25,800	290.00	7,482,000
日本精線	2,500	4,750.00	11,875,000
エンビプロ・ホールディングス	7,500	1,377.00	10,327,500
シンニッタン	21,400	231.00	4,943,400
新家工業	4,400	1,526.00	6,714,400
大紀アルミニウム工業所	26,400	1,254.00	33,105,600
日本軽金属ホールディングス	47,600	1,823.00	86,774,800
三井金属鉱業	47,100	3,205.00	150,955,500
東邦亜鉛	9,700	1,905.00	18,478,500
三菱マテリアル	115,400	2,101.00	242,455,400
住友金属鉱山	223,200	3,960.00	883,872,000
D O W Aホールディングス	44,200	4,460.00	197,132,000
古河機械金属	28,900	1,202.00	34,737,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,300	742.00	13,578,600
東邦チタニウム	31,400	1,034.00	32,467,600
U A C J	26,500	2,480.00	65,720,000
C Kサンエツ	3,700	3,205.00	11,858,500
古河電気工業	54,300	2,275.00	123,532,500

住友電気工業	609,400	1,388.50	846,151,900
フジクラ	211,000	594.00	125,334,000
昭和電線ホールディングス	17,000	2,003.00	34,051,000
東京特殊電線	2,300	2,601.00	5,982,300
タツタ電線	31,000	505.00	15,655,000
カナレ電気	2,700	1,686.00	4,552,200
平河ヒューテック	9,800	1,117.00	10,946,600
リョービ	21,600	1,243.00	26,848,800
アーレスティ	21,700	409.00	8,875,300
アサヒホールディングス	65,600	2,105.00	138,088,000
稲葉製作所	9,800	1,407.00	13,788,600
宮地エンジニアリンググループ	5,700	2,502.00	14,261,400
トーカロ	45,000	1,264.00	56,880,000
アルファC o	6,200	1,205.00	7,471,000
SUMCO	222,700	2,135.00	475,464,500
川田テクノロジーズ	3,600	3,535.00	12,726,000
RS Technologies	5,700	5,150.00	29,355,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,706.00	5,141,400
信和	9,300	692.00	6,435,600
東洋製罐グループホールディングス	111,200	1,503.00	167,133,600
ホッカンホールディングス	8,900	1,400.00	12,460,000
コロナ	9,700	901.00	8,739,700
横河ブリッジホールディングス	30,000	2,085.00	62,550,000
駒井ハルテック	3,500	1,620.00	5,670,000
高田機工	1,600	2,750.00	4,400,000
三和ホールディングス	164,600	1,385.00	227,971,000
文化シャッター	51,400	1,137.00	58,441,800
三協立山	22,500	732.00	16,470,000
アルインコ	11,500	996.00	11,454,000
東洋シャッター	3,900	638.00	2,488,200
LIXIL	240,500	3,000.00	721,500,000
日本フィルコン	12,200	498.00	6,075,600
ノーリツ	33,400	1,835.00	61,289,000
長府製作所	17,800	1,998.00	35,564,400
リンナイ	34,000	11,000.00	374,000,000
ダイニチ工業	8,400	733.00	6,157,200
日東精工	21,900	632.00	13,840,800
三洋工業	2,100	1,851.00	3,887,100
岡部	35,400	646.00	22,868,400
ジーテクト	21,700	1,387.00	30,097,900
東プレ	32,600	1,296.00	42,249,600
高周波熱錬	33,600	593.00	19,924,800

東京製綱	12,500	927.00	11,587,500
サンコール	14,900	434.00	6,466,600
モリテック スチール	13,600	410.00	5,576,000
パイオラックス	25,800	1,454.00	37,513,200
エイチワン	17,100	667.00	11,405,700
日本発條	173,900	744.00	129,381,600
中央発條	8,400	1,050.00	8,820,000
アドバネクス	2,500	1,171.00	2,927,500
立川ブラインド工業	7,700	1,282.00	9,871,400
三益半導体工業	13,600	2,199.00	29,906,400
日本ドライケミカル	4,400	1,971.00	8,672,400
日本製鋼所	53,100	2,380.00	126,378,000
三浦工業	75,600	4,805.00	363,258,000
タクマ	59,300	1,655.00	98,141,500
ツガミ	36,400	1,469.00	53,471,600
オークマ	20,400	4,940.00	100,776,000
芝浦機械	18,200	2,465.00	44,863,000
アマダ	256,200	1,057.00	270,803,400
アイダエンジニアリング	46,000	981.00	45,126,000
滝澤鉄工所	5,100	1,112.00	5,671,200
F U J I	69,700	2,470.00	172,159,000
牧野フライス製作所	20,500	3,785.00	77,592,500
オーエスジー	80,900	1,847.00	149,422,300
ダイジェット工業	2,200	1,186.00	2,609,200
旭ダイヤモンド工業	46,400	499.00	23,153,600
D M G 森精機	103,700	1,802.00	186,867,400
ソディック	38,800	898.00	34,842,400
ディスコ	23,700	30,750.00	728,775,000
日東工器	8,400	1,889.00	15,867,600
日進工具	13,800	1,339.00	18,478,200
パンチ工業	14,700	532.00	7,820,400
富士ダイス	8,900	641.00	5,704,900
豊和工業	10,000	808.00	8,080,000
O K K	6,700	381.00	2,552,700
東洋機械金属	12,700	469.00	5,956,300
津田駒工業	3,400	815.00	2,771,000
エンシュウ	4,500	781.00	3,514,500
島精機製作所	25,700	1,922.00	49,395,400
オプトラン	21,900	2,109.00	46,187,100
N C ホールディングス	5,300	1,087.00	5,761,100
イワキポンプ	11,200	890.00	9,968,000
フリュー	17,100	1,467.00	25,085,700

ヤマシンフィルタ	35,300	582.00	20,544,600
日阪製作所	21,600	809.00	17,474,400
やまびこ	33,900	1,210.00	41,019,000
野村マイクロ・サイエンス	3,800	4,365.00	16,587,000
平田機工	8,300	6,170.00	51,211,000
ペガサスミシン製造	17,900	415.00	7,428,500
マルマエ	7,200	1,827.00	13,154,400
タツモ	8,200	1,411.00	11,570,200
ナブテスコ	103,000	4,270.00	439,810,000
三井海洋開発	18,600	1,606.00	29,871,600
レオン自動機	17,200	1,420.00	24,424,000
S M C	51,700	66,770.00	3,452,009,000
ホソカワミクロン	6,200	6,340.00	39,308,000
ユニオンツール	6,500	3,720.00	24,180,000
オイレス工業	24,500	1,572.00	38,514,000
日精エー・エス・ビー機械	5,900	3,950.00	23,305,000
サトーホールディングス	23,000	2,622.00	60,306,000
技研製作所	15,400	4,455.00	68,607,000
日本エアーテック	8,100	1,063.00	8,610,300
カワタ	4,800	859.00	4,123,200
日精樹脂工業	13,700	1,072.00	14,686,400
オカダアイヨン	5,600	1,256.00	7,033,600
ワイエイシイホールディングス	7,000	872.00	6,104,000
小松製作所	800,100	2,599.50	2,079,859,950
住友重機械工業	101,200	2,835.00	286,902,000
日立建機	82,600	2,980.00	246,148,000
日工	26,800	658.00	17,634,400
巴工業	7,000	2,254.00	15,778,000
井関農機	16,600	1,514.00	25,132,400
T O W A	16,500	2,330.00	38,445,000
丸山製作所	3,800	1,559.00	5,924,200
北川鉄工所	8,100	1,541.00	12,482,100
ローツェ	7,700	7,360.00	56,672,000
タカキタ	6,300	593.00	3,735,900
クボタ	861,400	2,131.50	1,836,074,100
荏原実業	8,200	2,525.00	20,705,000
三菱化工機	5,800	2,230.00	12,934,000
月島機械	32,800	1,132.00	37,129,600
帝国電機製作所	12,400	1,276.00	15,822,400
新東工業	42,300	751.00	31,767,300
澁谷工業	15,500	2,893.00	44,841,500
アイチ コーポレーション	30,400	739.00	22,465,600

小森コーポレーション	45,100	807.00	36,395,700
鶴見製作所	13,700	1,720.00	23,564,000
住友精密工業	2,700	2,336.00	6,307,200
日本ギア工業	7,300	292.00	2,131,600
酒井重工業	3,200	2,384.00	7,628,800
荏原製作所	73,300	5,310.00	389,223,000
石井鐵工所	2,600	3,015.00	7,839,000
西島製作所	17,900	861.00	15,411,900
北越工業	18,300	1,067.00	19,526,100
ダイキン工業	224,900	25,540.00	5,743,946,000
オルガノ	5,800	5,960.00	34,568,000
トーヨーカネツ	6,800	2,368.00	16,102,400
栗田工業	95,600	4,810.00	459,836,000
椿本チエイン	25,300	3,280.00	82,984,000
大同工業	8,700	979.00	8,517,300
木村化工機	15,100	714.00	10,781,400
アネスト岩田	29,800	990.00	29,502,000
ダイフク	97,200	9,250.00	899,100,000
サムコ	4,400	2,742.00	12,064,800
加藤製作所	10,000	852.00	8,520,000
油研工業	3,100	1,708.00	5,294,800
タダノ	85,400	1,115.00	95,221,000
フジテック	60,800	2,618.00	159,174,400
C K D	41,000	2,181.00	89,421,000
キトー	14,900	1,632.00	24,316,800
平和	49,300	1,925.00	94,902,500
理想科学工業	13,000	2,294.00	29,822,000
S A N K Y O	42,000	2,792.00	117,264,000
日本金銭機械	19,700	543.00	10,697,100
マースグループホールディングス	11,300	1,640.00	18,532,000
フクシマガリレイ	12,100	4,565.00	55,236,500
オーイズミ	7,600	381.00	2,895,600
ダイコク電機	8,200	895.00	7,339,000
竹内製作所	29,600	2,512.00	74,355,200
アマノ	46,300	2,678.00	123,991,400
J U K I	24,600	733.00	18,031,800
蛇の目ミシン工業	16,200	652.00	10,562,400
マックス	23,700	1,826.00	43,276,200
グローリー	45,400	2,225.00	101,015,000
新晃工業	16,400	2,106.00	34,538,400
大和冷機工業	25,600	1,103.00	28,236,800
セガサミーホールディングス	160,600	1,326.00	212,955,600

日本ピストンリング	6,500	1,301.00	8,456,500
リケン	8,200	2,469.00	20,245,800
T P R	23,800	1,451.00	34,533,800
ツバキ・ナカシマ	38,700	1,425.00	55,147,500
ホシザキ	51,600	9,820.00	506,712,000
大豊工業	14,500	811.00	11,759,500
日本精工	362,700	757.00	274,563,900
N T N	408,600	240.00	98,064,000
ジェイテクト	169,400	936.00	158,558,400
不二越	15,000	4,180.00	62,700,000
日本トムソン	48,500	538.00	26,093,000
T H K	102,800	2,385.00	245,178,000
ユーシン精機	11,800	825.00	9,735,000
前澤給装工業	12,400	1,018.00	12,623,200
イーグル工業	21,900	1,200.00	26,280,000
前澤工業	10,700	660.00	7,062,000
日本ピラー工業	17,900	2,336.00	41,814,400
キッツ	59,600	807.00	48,097,200
マキタ	230,300	5,730.00	1,319,619,000
日立造船	140,300	780.00	109,434,000
三菱重工業	277,500	2,812.00	780,330,000
I H I	118,800	2,376.00	282,268,800
スター精密	27,200	1,435.00	39,032,000
日清紡ホールディングス	108,000	883.00	95,364,000
イビデン	85,100	5,370.00	456,987,000
コニカミノルタ	360,100	527.00	189,772,700
ブラザー工業	216,100	2,267.00	489,898,700
ミネベアミツミ	304,700	2,705.00	824,213,500
日立製作所	848,900	5,945.00	5,046,710,500
東芝	349,400	4,450.00	1,554,830,000
三菱電機	1,765,500	1,442.50	2,546,733,750
富士電機	106,400	4,400.00	468,160,000
東洋電機製造	6,900	1,066.00	7,355,400
安川電機	190,000	5,150.00	978,500,000
シンフォニアテクノロジー	22,900	1,120.00	25,648,000
明電舎	29,900	2,285.00	68,321,500
オリジン	4,800	1,240.00	5,952,000
山洋電気	8,700	6,500.00	56,550,000
デンヨー	15,000	2,036.00	30,540,000
東芝テック	19,000	4,400.00	83,600,000
芝浦メカトロニクス	3,300	6,160.00	20,328,000
マブチモーター	41,600	3,770.00	156,832,000

日本電産	425,000	12,040.00	5,117,000,000
トレックス・セミコンダクター	9,900	2,466.00	24,413,400
東光高岳	9,700	1,400.00	13,580,000
ダイヘン	19,300	4,550.00	87,815,000
ヤーマン	29,800	1,010.00	30,098,000
JVCケンウッド	157,900	201.00	31,737,900
ミマキエンジニアリング	17,200	836.00	14,379,200
I-PEX	8,700	1,941.00	16,886,700
日新電機	41,400	1,210.00	50,094,000
大崎電気工業	35,100	541.00	18,989,100
オムロン	147,000	9,680.00	1,422,960,000
日東工業	25,900	1,697.00	43,952,300
I D E C	23,700	2,048.00	48,537,600
正興電機製作所	6,300	1,349.00	8,498,700
不二電機工業	3,800	1,279.00	4,860,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	63,900	2,446.00	156,299,400
サクサホールディングス	4,100	1,335.00	5,473,500
メルコホールディングス	6,300	5,270.00	33,201,000
テクノメディカ	4,700	1,597.00	7,505,900
日本電気	224,400	5,510.00	1,236,444,000
富士通	158,900	18,745.00	2,978,580,500
沖電気工業	71,700	935.00	67,039,500
岩崎通信機	7,700	926.00	7,130,200
電気興業	8,500	2,253.00	19,150,500
サンケン電気	20,600	4,775.00	98,365,000
ナカヨ	3,400	1,416.00	4,814,400
アイホン	10,000	1,950.00	19,500,000
ルネサスエレクトロニクス	954,200	1,085.00	1,035,307,000
セイコーエプソン	219,100	2,117.00	463,834,700
ワコム	129,300	685.00	88,570,500
アルバック	32,500	5,640.00	183,300,000
アクセル	8,800	728.00	6,406,400
E I Z O	15,000	4,125.00	61,875,000
日本信号	41,200	902.00	37,162,400
京三製作所	37,900	441.00	16,713,900
能美防災	23,900	2,055.00	49,114,500
ホーチキ	13,800	1,120.00	15,456,000
星和電機	10,300	499.00	5,139,700
エレコム	41,100	1,681.00	69,089,100
パナソニック	1,882,900	1,224.00	2,304,669,600
シャープ	234,800	1,441.00	338,346,800
アンリツ	106,100	1,796.00	190,555,600

富士通ゼネラル	53,900	2,755.00	148,494,500
ソニーグループ	1,106,000	10,620.00	11,745,720,000
T D K	85,300	11,430.00	974,979,000
帝国通信工業	8,700	1,277.00	11,109,900
タムラ製作所	63,500	705.00	44,767,500
アルプスアルパイン	145,200	1,071.00	155,509,200
池上通信機	5,600	780.00	4,368,000
鈴木	9,200	787.00	7,240,400
メイコー	13,600	2,485.00	33,796,000
日本トリム	4,100	3,710.00	15,211,000
ローランド ディー . ジー .	10,800	2,733.00	29,516,400
フォスター電機	17,800	827.00	14,720,600
S M K	4,500	2,171.00	9,769,500
ヨコオ	14,700	2,500.00	36,750,000
ホシデン	47,300	880.00	41,624,000
ヒロセ電機	27,200	16,930.00	460,496,000
日本航空電子工業	40,500	1,583.00	64,111,500
T O A	20,800	803.00	16,702,400
マクセルホールディングス	35,900	1,264.00	45,377,600
古野電気	23,700	1,043.00	24,719,100
ユニデンホールディングス	4,200	2,503.00	10,512,600
スミダコーポレーション	17,300	1,243.00	21,503,900
アイコム	7,300	2,400.00	17,520,000
リオン	7,900	2,446.00	19,323,400
本多通信工業	16,100	456.00	7,341,600
横河電機	176,700	1,641.00	289,964,700
新電元工業	6,800	3,745.00	25,466,000
アズビル	119,400	4,370.00	521,778,000
東亜ディーケーケー	10,100	843.00	8,514,300
日本光電工業	73,300	3,585.00	262,780,500
チノー	5,600	1,403.00	7,856,800
共和電業	16,900	372.00	6,286,800
日本電子材料	7,300	1,701.00	12,417,300
堀場製作所	32,600	7,320.00	238,632,000
アドバンテスト	131,300	8,840.00	1,160,692,000
小野測器	9,500	540.00	5,130,000
エスベック	16,100	2,071.00	33,343,100
キーエンス	173,300	61,880.00	10,723,804,000
日置電機	8,600	7,560.00	65,016,000
シスメックス	137,900	11,750.00	1,620,325,000
日本マイクロニクス	31,500	1,320.00	41,580,000
メガチップス	18,000	2,965.00	53,370,000

OBARA GROUP	8,300	3,640.00	30,212,000
澤藤電機	2,400	1,912.00	4,588,800
原田工業	8,400	917.00	7,702,800
コーセル	22,600	982.00	22,193,200
イリソ電子工業	15,000	4,370.00	65,550,000
オブテックスグループ	29,700	1,382.00	41,045,400
千代田インテグレ	8,000	1,870.00	14,960,000
アイ・オー・データ機器	7,700	890.00	6,853,000
レーザーテック	77,600	19,150.00	1,486,040,000
スタンレー電気	123,900	2,630.00	325,857,000
岩崎電気	7,000	1,976.00	13,832,000
ウシオ電機	91,100	1,878.00	171,085,800
岡谷電機産業	15,900	340.00	5,406,000
ヘリオス テクノ ホールディング	19,600	321.00	6,291,600
エノモト	5,600	1,487.00	8,327,200
日本セラミック	16,800	2,878.00	48,350,400
遠藤照明	10,300	814.00	8,384,200
古河電池	13,300	1,368.00	18,194,400
双信電機	10,200	682.00	6,956,400
山一電機	12,200	1,515.00	18,483,000
図研	11,800	3,340.00	39,412,000
日本電子	32,300	7,000.00	226,100,000
カシオ計算機	142,000	1,668.00	236,856,000
ファナック	155,000	22,635.00	3,508,425,000
日本シイエムケイ	41,000	395.00	16,195,000
エンプラス	8,300	3,075.00	25,522,500
大真空	6,300	2,965.00	18,679,500
ローム	73,500	9,530.00	700,455,000
浜松ホトニクス	126,800	6,040.00	765,872,000
三井ハイテック	17,500	5,950.00	104,125,000
新光電気工業	59,600	3,220.00	191,912,000
京セラ	269,300	6,642.00	1,788,690,600
太陽誘電	78,700	5,560.00	437,572,000
村田製作所	518,800	8,784.00	4,557,139,200
双葉電子工業	31,600	764.00	24,142,400
北陸電気工業	7,700	977.00	7,522,900
ニチコン	56,700	1,007.00	57,096,900
日本ケミコン	17,800	1,929.00	34,336,200
K O A	25,100	1,494.00	37,499,400
市光工業	22,800	616.00	14,044,800
小糸製作所	105,900	6,160.00	652,344,000
ミツバ	32,500	613.00	19,922,500

SCREENホールディングス	30,600	8,680.00	265,608,000
キャノン電子	16,900	1,529.00	25,840,100
キャノン	877,300	2,532.50	2,221,762,250
リコー	449,200	1,074.00	482,440,800
象印マホービン	48,500	1,596.00	77,406,000
MUTOHホールディングス	3,000	1,572.00	4,716,000
東京エレクトロン	103,400	42,940.00	4,439,996,000
トヨタ紡織	51,500	1,898.00	97,747,000
芦森工業	3,400	998.00	3,393,200
ユニプレス	29,000	905.00	26,245,000
豊田自動織機	142,900	8,650.00	1,236,085,000
モリタホールディングス	28,300	1,502.00	42,506,600
三櫻工業	24,500	1,104.00	27,048,000
デンソー	388,700	6,721.00	2,612,452,700
東海理化電機製作所	46,500	1,548.00	71,982,000
三井E & Sホールディングス	68,300	489.00	33,398,700
川崎重工業	138,100	2,276.00	314,315,600
名村造船所	53,000	232.00	12,296,000
日本車輛製造	6,400	2,069.00	13,241,600
三菱ロジスネクスト	23,400	870.00	20,358,000
近畿車輛	3,000	1,142.00	3,426,000
日産自動車	2,082,300	524.70	1,092,582,810
いすゞ自動車	468,800	1,324.00	620,691,200
トヨタ自動車	1,788,700	8,915.00	15,946,260,500
日野自動車	220,500	856.00	188,748,000
三菱自動車工業	653,500	268.00	175,138,000
エフテック	12,400	598.00	7,415,200
レシップホールディングス	7,000	580.00	4,060,000
GMB	3,300	859.00	2,834,700
ファルテック	3,200	677.00	2,166,400
武蔵精密工業	39,400	1,785.00	70,329,000
日産車体	25,900	691.00	17,896,900
新明和工業	49,900	908.00	45,309,200
極東開発工業	30,500	1,589.00	48,464,500
トピー工業	14,600	1,130.00	16,498,000
ティラド	5,500	2,919.00	16,054,500
曙ブレーキ工業	96,900	175.00	16,957,500
タチエス	27,100	1,270.00	34,417,000
NOK	85,500	1,292.00	110,466,000
フタバ産業	44,400	445.00	19,758,000
KYB	19,800	2,913.00	57,677,400
大同メタル工業	36,600	557.00	20,386,200

プレス工業	87,700	332.00	29,116,400
ミクニ	22,700	301.00	6,832,700
太平洋工業	37,000	1,205.00	44,585,000
河西工業	24,000	363.00	8,712,000
アイシン	129,200	3,945.00	509,694,000
マツダ	554,100	902.00	499,798,200
今仙電機製作所	15,600	667.00	10,405,200
本田技研工業	1,390,100	3,221.00	4,477,512,100
スズキ	350,000	4,443.00	1,555,050,000
S U B A R U	506,000	1,992.00	1,007,952,000
安永	8,600	1,058.00	9,098,800
ヤマハ発動機	230,400	2,649.00	610,329,600
T B K	21,200	398.00	8,437,600
エクセディ	24,000	1,581.00	37,944,000
豊田合成	57,100	2,233.00	127,504,300
愛三工業	27,700	793.00	21,966,100
盟和産業	2,800	955.00	2,674,000
日本プラスト	15,000	587.00	8,805,000
ヨロズ	15,200	1,145.00	17,404,000
エフ・シー・シー	28,900	1,464.00	42,309,600
シマノ	71,200	30,300.00	2,157,360,000
テイ・エス テック	82,100	1,453.00	119,291,300
ジャムコ	10,400	960.00	9,984,000
テルモ	541,300	4,533.00	2,453,712,900
クリエートメディック	5,300	963.00	5,103,900
日機装	53,000	865.00	45,845,000
日本エム・ディ・エム	10,200	2,170.00	22,134,000
島津製作所	227,200	4,760.00	1,081,472,000
J M S	15,000	725.00	10,875,000
長野計器	12,800	1,009.00	12,915,200
ブイ・テクノロジー	8,300	4,265.00	35,399,500
東京計器	11,300	976.00	11,028,800
愛知時計電機	2,300	4,770.00	10,971,000
インターアクション	8,800	2,527.00	22,237,600
オーバル	15,900	259.00	4,118,100
東京精密	29,800	4,500.00	134,100,000
マニー	70,300	2,186.00	153,675,800
ニコン	269,600	1,070.00	288,472,000
トプコン	89,000	1,664.00	148,096,000
オリンパス	925,900	2,264.00	2,096,237,600
理研計器	15,600	2,576.00	40,185,600
タムロン	13,700	2,489.00	34,099,300

HOYA	344,500	16,740.00	5,766,930,000
シード	6,900	678.00	4,678,200
ノーリツ鋼機	15,900	2,392.00	38,032,800
エー・アンド・デイ	14,900	970.00	14,453,000
朝日インテック	189,500	3,135.00	594,082,500
シチズン時計	224,100	456.00	102,189,600
リズム	5,600	1,045.00	5,852,000
大研医器	14,000	533.00	7,462,000
メニコン	27,100	8,430.00	228,453,000
シンシア	2,000	535.00	1,070,000
松風	8,100	1,897.00	15,365,700
セイコーホールディングス	25,000	2,091.00	52,275,000
ニプロ	131,600	1,256.00	165,289,600
中本パックス	4,500	1,640.00	7,380,000
スノーピーク	11,500	4,710.00	54,165,000
パラマウントベッドホールディングス	33,900	1,980.00	67,122,000
トランザクション	9,700	1,057.00	10,252,900
粧美堂	5,100	406.00	2,070,600
ニホンフラッシュ	15,100	1,216.00	18,361,600
前田工織	19,500	3,470.00	67,665,000
永大産業	23,100	297.00	6,860,700
アートネイチャー	17,000	679.00	11,543,000
バンダイナムコホールディングス	146,000	7,180.00	1,048,280,000
アイフィスジャパン	4,500	660.00	2,970,000
共立印刷	29,600	154.00	4,558,400
SHOEI	16,600	4,460.00	74,036,000
フランスベッドホールディングス	22,700	917.00	20,815,900
パイロットコーポレーション	29,800	4,130.00	123,074,000
萩原工業	11,400	1,450.00	16,530,000
トッパン・フォームズ	31,500	995.00	31,342,500
フジシールインターナショナル	36,300	2,333.00	84,687,900
タカラトミー	79,200	1,063.00	84,189,600
廣済堂	12,300	897.00	11,033,100
エステールホールディングス	4,700	645.00	3,031,500
タカノ	6,000	680.00	4,080,000
プロネクサス	14,200	1,013.00	14,384,600
ホクシン	10,900	151.00	1,645,900
ウッドワン	5,900	1,040.00	6,136,000
大建工業	11,900	2,289.00	27,239,100
凸版印刷	268,400	1,820.00	488,488,000
大日本印刷	208,700	2,528.00	527,593,600
共同印刷	5,400	2,600.00	14,040,000

N I S S H A	36,200	1,625.00	58,825,000
光村印刷	1,500	1,625.00	2,437,500
T A K A R A & C O M P A N Y	8,700	1,697.00	14,763,900
アシックス	156,100	2,479.00	386,971,900
ツツミ	4,400	2,371.00	10,432,400
ローランド	12,300	4,905.00	60,331,500
小松ウオール工業	5,400	1,902.00	10,270,800
ヤマハ	105,000	5,930.00	622,650,000
河合楽器製作所	4,900	3,740.00	18,326,000
クリナップ	16,400	553.00	9,069,200
ピジョン	106,700	3,200.00	341,440,000
オリバー	4,200	3,765.00	15,813,000
兼松サステック	1,100	1,765.00	1,941,500
キングジム	14,200	856.00	12,155,200
リンテック	37,800	2,378.00	89,888,400
イトーキ	32,500	350.00	11,375,000
任天堂	101,000	52,410.00	5,293,410,000
三菱鉛筆	29,100	1,411.00	41,060,100
タカラスタンド	36,500	1,668.00	60,882,000
コクヨ	84,700	1,893.00	160,337,100
ナカバヤシ	17,400	569.00	9,900,600
グローブライド	8,600	7,490.00	64,414,000
オカムラ	60,700	1,668.00	101,247,600
美津濃	17,500	2,524.00	44,170,000
東京電力ホールディングス	1,497,500	289.00	432,777,500
中部電力	540,200	1,343.50	725,758,700
関西電力	669,000	1,094.00	731,886,000
中国電力	254,700	1,028.00	261,831,600
北陸電力	161,400	576.00	92,966,400
東北電力	413,500	843.00	348,580,500
四国電力	146,700	753.00	110,465,100
九州電力	389,900	844.00	329,075,600
北海道電力	165,200	501.00	82,765,200
沖縄電力	34,300	1,434.00	49,186,200
電源開発	140,500	1,611.00	226,345,500
エフオン	10,700	824.00	8,816,800
イーレックス	25,900	2,231.00	57,782,900
レノバ	30,000	4,380.00	131,400,000
東京瓦斯	339,500	2,138.00	725,851,000
大阪瓦斯	319,800	2,097.00	670,620,600
東邦瓦斯	86,800	5,380.00	466,984,000
北海道瓦斯	9,500	1,531.00	14,544,500

広島ガス	36,400	371.00	13,504,400
西部ガスホールディングス	19,900	2,429.00	48,337,100
静岡ガス	45,900	1,227.00	56,319,300
メタウォーター	19,900	1,834.00	36,496,600
SBSホールディングス	13,100	3,650.00	47,815,000
東武鉄道	184,000	2,825.00	519,800,000
相鉄ホールディングス	60,500	2,176.00	131,648,000
東急	445,300	1,450.00	645,685,000
京浜急行電鉄	226,700	1,346.00	305,138,200
小田急電鉄	282,800	2,548.00	720,574,400
京王電鉄	98,700	5,930.00	585,291,000
京成電鉄	132,300	3,240.00	428,652,000
富士急行	24,100	4,445.00	107,124,500
新京成電鉄	4,500	2,114.00	9,513,000
東日本旅客鉄道	310,800	7,147.00	2,221,287,600
西日本旅客鉄道	157,300	5,723.00	900,227,900
東海旅客鉄道	146,800	15,730.00	2,309,164,000
西武ホールディングス	212,800	1,191.00	253,444,800
鴻池運輸	28,100	1,300.00	36,530,000
西日本鉄道	48,900	2,753.00	134,621,700
ハマキョウレックス	13,500	3,160.00	42,660,000
サカイ引越センター	8,100	4,665.00	37,786,500
近鉄グループホールディングス	167,200	3,665.00	612,788,000
阪急阪神ホールディングス	223,000	3,265.00	728,095,000
南海電気鉄道	79,300	2,323.00	184,213,900
京阪ホールディングス	74,500	2,931.00	218,359,500
神戸電鉄	4,000	3,475.00	13,900,000
名古屋鉄道	137,500	1,867.00	256,712,500
山陽電気鉄道	11,900	1,927.00	22,931,300
アルプス物流	11,700	904.00	10,576,800
日本通運	57,900	6,980.00	404,142,000
ヤマトホールディングス	234,300	2,832.00	663,537,600
山九	42,900	4,825.00	206,992,500
丸運	9,500	271.00	2,574,500
丸全昭和運輸	13,600	3,220.00	43,792,000
センコーグループホールディングス	92,200	1,005.00	92,661,000
トナミホールディングス	4,000	4,440.00	17,760,000
ニッコンホールディングス	56,100	2,311.00	129,647,100
日本石油輸送	1,800	2,631.00	4,735,800
福山通運	21,400	4,355.00	93,197,000
セイノーホールディングス	125,200	1,372.00	171,774,400
エスライン	4,600	902.00	4,149,200

神奈川中央交通	4,100	3,410.00	13,981,000
日立物流	34,500	4,430.00	152,835,000
丸和運輸機関	35,300	1,410.00	49,773,000
C & F ロジホールディングス	16,900	1,593.00	26,921,700
九州旅客鉄道	129,300	2,412.00	311,871,600
S Gホールディングス	315,900	3,035.00	958,756,500
日本郵船	140,100	7,290.00	1,021,329,000
商船三井	99,500	6,460.00	642,770,000
川崎汽船	51,500	4,510.00	232,265,000
N S ユナイテッド海運	8,600	3,050.00	26,230,000
飯野海運	82,400	475.00	39,140,000
共栄タンカー	5,400	991.00	5,351,400
乾汽船	11,400	1,765.00	20,121,000
日本航空	407,400	2,208.00	899,539,200
A N Aホールディングス	451,300	2,497.50	1,127,121,750
パスコ	3,200	1,360.00	4,352,000
トランコム	5,100	8,160.00	41,616,000
日新	13,300	1,449.00	19,271,700
三菱倉庫	57,900	3,065.00	177,463,500
三井倉庫ホールディングス	17,700	2,605.00	46,108,500
住友倉庫	59,100	1,674.00	98,933,400
澁澤倉庫	9,200	2,088.00	19,209,600
東陽倉庫	28,000	316.00	8,848,000
日本トランスシティ	36,800	559.00	20,571,200
ケイヒン	3,200	1,389.00	4,444,800
中央倉庫	10,200	977.00	9,965,400
川西倉庫	3,100	1,078.00	3,341,800
安田倉庫	13,700	931.00	12,754,700
ファイズホールディングス	3,000	706.00	2,118,000
東洋埠頭	5,100	1,465.00	7,471,500
宇徳	11,900	528.00	6,283,200
上組	92,000	2,208.00	203,136,000
サンリツ	4,300	765.00	3,289,500
キムラユニティー	4,500	1,275.00	5,737,500
キューソー流通システム	4,200	1,681.00	7,060,200
近鉄エクスプレス	31,600	2,511.00	79,347,600
東海運	9,500	316.00	3,002,000
エーアイティー	10,500	1,041.00	10,930,500
内外トランスライン	6,500	1,884.00	12,246,000
日本コンセプト	5,300	2,040.00	10,812,000
N E C ネットズエスアイ	57,400	1,991.00	114,283,400
クロスキャット	4,900	989.00	4,846,100

システナ	61,900	2,032.00	125,780,800
デジタルアーツ	10,100	8,110.00	81,911,000
日鉄ソリューションズ	25,100	3,620.00	90,862,000
キューブシステム	9,100	1,004.00	9,136,400
WOW WORLD	2,900	1,495.00	4,335,500
コア	7,500	1,436.00	10,770,000
ラクーンホールディングス	12,400	2,158.00	26,759,200
ソリトンシステムズ	8,800	1,343.00	11,818,400
ソフトクリエイイトホールディングス	6,900	2,806.00	19,361,400
T I S	173,300	2,957.00	512,448,100
J N Sホールディングス	8,600	458.00	3,938,800
グリー	106,600	635.00	67,691,000
G M Oペパボ	1,900	3,480.00	6,612,000
コーエーテクモホールディングス	46,100	4,525.00	208,602,500
三菱総合研究所	7,500	3,990.00	29,925,000
電算	2,100	2,235.00	4,693,500
A G S	9,200	871.00	8,013,200
ファインデックス	14,900	988.00	14,721,200
ブレインパッド	4,500	4,635.00	20,857,500
K L a b	31,800	618.00	19,652,400
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	23,200	1,042.00	24,174,400
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	3,455.00	10,019,500
ネクソン	390,200	2,090.00	815,518,000
アイスタイル	53,400	427.00	22,801,800
エムアップホールディングス	4,600	2,793.00	12,847,800
エイチーム	12,100	1,392.00	16,843,200
エニグモ	16,500	1,367.00	22,555,500
テクノスジャパン	14,000	583.00	8,162,000
コロプラ	57,200	804.00	45,988,800
ブロードリーフ	86,300	502.00	43,322,600
クロス・マーケティンググループ	7,200	772.00	5,558,400
デジタルハーツホールディングス	8,100	1,818.00	14,725,800
システム情報	13,300	901.00	11,983,300
メディアドゥ	6,800	4,705.00	31,994,000
じげん	43,500	387.00	16,834,500
ブイキューブ	17,700	1,709.00	30,249,300
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	607.00	2,185,200
サイバーリンクス	6,000	1,354.00	8,124,000
フィックスターズ	18,800	715.00	13,442,000
C A R T A H O L D I N G S	7,100	1,735.00	12,318,500
オブティム	12,200	1,883.00	22,972,600
セレス	6,400	2,585.00	16,544,000

S H I F T	8,700	22,450.00	195,315,000
ティーガイア	18,600	1,904.00	35,414,400
セック	2,700	2,382.00	6,431,400
日本アジアグループ	16,700	963.00	16,082,100
テクマトリックス	27,000	1,667.00	45,009,000
プロシップ	5,300	1,527.00	8,093,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	47,100	2,139.00	100,746,900
GMOペイメントゲートウェイ	33,600	13,680.00	459,648,000
ザッパラス	7,400	554.00	4,099,600
システムリサーチ	5,200	1,793.00	9,323,600
インターネットイニシアティブ	46,200	3,445.00	159,159,000
さくらインターネット	19,100	584.00	11,154,400
ヴィンクス	5,200	862.00	4,482,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,900	4,165.00	16,243,500
SRAホールディングス	9,300	2,736.00	25,444,800
システムインテグレータ	5,500	596.00	3,278,000
朝日ネット	14,500	707.00	10,251,500
eBASE	21,000	790.00	16,590,000
アバント	18,700	1,499.00	28,031,300
アドソル日進	6,300	1,961.00	12,354,300
ODKソリューションズ	4,100	664.00	2,722,400
フリービット	10,700	804.00	8,602,800
コムチュア	16,000	2,569.00	41,104,000
サイバーコム	2,900	1,236.00	3,584,400
アステリア	12,900	613.00	7,907,700
アイル	9,800	1,692.00	16,581,600
マークライnz	8,800	2,616.00	23,020,800
メディカル・データ・ビジョン	22,100	1,603.00	35,426,300
gumi	24,300	796.00	19,342,800
ショーケース	4,300	633.00	2,721,900
モバイルファクトリー	4,200	1,007.00	4,229,400
テラスカイ	5,800	1,878.00	10,892,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	1,761.00	13,735,800
PCIホールディングス	8,100	1,012.00	8,197,200
パイブDHD	3,700	2,158.00	7,984,600
アイビーシー	3,200	864.00	2,764,800
ネオジャパン	3,500	1,438.00	5,033,000
P R T I M E S	3,800	2,809.00	10,674,200
ラクス	52,200	3,575.00	186,615,000
ランドコンピュータ	3,000	1,102.00	3,306,000
ダブルスタンダード	2,300	6,750.00	15,525,000
オープンドア	10,400	1,861.00	19,354,400

マイネット	6,200	601.00	3,726,200
アカツキ	7,000	3,120.00	21,840,000
ベネフィットジャパン	1,500	2,220.00	3,330,000
Ubicomホールディングス	4,600	2,980.00	13,708,000
カナミックネットワーク	19,000	596.00	11,324,000
ノムラシステムコーポレーション	9,600	278.00	2,668,800
チェンジ	32,000	2,173.00	69,536,000
シンクロ・フード	11,400	355.00	4,047,000
オークネット	9,400	1,870.00	17,578,000
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	957.00	3,636,600
セグエグループ	4,800	813.00	3,902,400
エイトレッド	3,400	2,153.00	7,320,200
マクロミル	35,700	690.00	24,633,000
ビーグリー	4,200	1,428.00	5,997,600
オロ	5,500	3,200.00	17,600,000
ユーザーローカル	5,400	1,730.00	9,342,000
テモナ	4,100	775.00	3,177,500
ニーズウェル	4,200	674.00	2,830,800
マネーフォワード	26,200	7,360.00	192,832,000
サインポスト	4,200	598.00	2,511,600
電算システムホールディングス	7,200	2,597.00	18,698,400
ソルクシーズ	7,600	891.00	6,771,600
フェイス	5,800	652.00	3,781,600
プロトコーポレーション	20,800	1,389.00	28,891,200
ハイマックス	5,200	1,084.00	5,636,800
野村総合研究所	301,000	3,830.00	1,152,830,000
サイバネットシステム	12,800	647.00	8,281,600
CEホールディングス	9,800	526.00	5,154,800
日本システム技術	3,300	1,918.00	6,329,400
インテージホールディングス	21,800	1,404.00	30,607,200
東邦システムサイエンス	4,900	959.00	4,699,100
ソースネクスト	83,100	229.00	19,029,900
インフォコム	15,900	2,334.00	37,110,600
HEROZ	5,100	1,823.00	9,297,300
ラクスル	18,900	5,220.00	98,658,000
IPS	4,200	2,043.00	8,580,600
FIG	20,100	264.00	5,306,400
システムサポート	5,400	1,265.00	6,831,000
イーソル	10,800	882.00	9,525,600
アルテリア・ネットワークス	19,300	1,760.00	33,968,000
EduLab	1,700	2,809.00	4,775,300
東海ソフト	3,000	1,215.00	3,645,000

ウイングアーク1st	9,500	1,970.00	18,715,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	1,782.00	7,306,200
サーバーワークス	1,800	3,440.00	6,192,000
東名	1,900	1,099.00	2,088,100
ヴィッツ	1,800	1,485.00	2,673,000
トピラシステムズ	3,600	1,129.00	4,064,400
Sansan	15,400	9,100.00	140,140,000
Link-U	3,300	1,435.00	4,735,500
ギフトィ	15,100	2,880.00	43,488,000
ベース	3,000	4,360.00	13,080,000
フォーカスシステムズ	11,900	933.00	11,102,700
クレスコ	11,500	1,860.00	21,390,000
フジ・メディア・ホールディングス	179,900	1,144.00	205,805,600
オービック	54,600	20,390.00	1,113,294,000
ジャストシステム	24,700	5,970.00	147,459,000
TDCソフト	15,400	1,266.00	19,496,400
Zホールディングス	2,380,800	650.20	1,547,996,160
トレンドマイクロ	92,600	5,830.00	539,858,000
IDホールディングス	10,300	917.00	9,445,100
日本オラクル	35,200	8,790.00	309,408,000
アルファシステムズ	4,700	3,665.00	17,225,500
フューチャー	18,400	2,232.00	41,068,800
CAC Holdings	10,300	1,519.00	15,645,700
SBテクノロジー	6,300	2,754.00	17,350,200
トーセ	5,200	786.00	4,087,200
オービックビジネスコンサルタント	16,600	5,530.00	91,798,000
伊藤忠テクノソリューションズ	79,000	3,305.00	261,095,000
アイティフォー	23,000	781.00	17,963,000
東計電算	2,100	4,795.00	10,069,500
エクスネット	3,100	1,006.00	3,118,600
大塚商会	93,800	5,760.00	540,288,000
サイボウズ	23,200	2,253.00	52,269,600
電通国際情報サービス	25,100	4,125.00	103,537,500
ACCESS	21,900	884.00	19,359,600
デジタルガレージ	28,700	4,640.00	133,168,000
EMシステムズ	28,900	796.00	23,004,400
ウェザーニューズ	5,200	5,610.00	29,172,000
CIJ	11,600	837.00	9,709,200
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,230.00	5,814,000
日本エンタープライズ	19,500	193.00	3,763,500
WOWOW	8,400	2,346.00	19,706,400
スカラ	15,900	714.00	11,352,600

インテリジェント ウェイブ	10,700	578.00	6,184,600
I M A G I C A G R O U P	15,500	450.00	6,975,000
ネットワンシステムズ	70,800	3,485.00	246,738,000
システムソフト	37,300	182.00	6,788,600
アルゴグラフィックス	13,500	3,115.00	42,052,500
マーベラス	27,700	669.00	18,531,300
エイベックス	30,000	1,426.00	42,780,000
日本ユニシス	60,200	2,891.00	174,038,200
兼松エレクトロニクス	9,500	3,630.00	34,485,000
都築電気	7,900	1,665.00	13,153,500
T B S ホールディングス	115,100	1,594.00	183,469,400
日本テレビホールディングス	144,800	1,182.00	171,153,600
朝日放送グループホールディングス	17,600	699.00	12,302,400
テレビ朝日ホールディングス	53,700	1,660.00	89,142,000
スカパーJ S A Tホールディングス	114,600	402.00	46,069,200
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,066.00	25,825,000
日本BS放送	6,200	1,118.00	6,931,600
ビジョン	29,800	1,038.00	30,932,400
スマートバリュー	5,100	648.00	3,304,800
U S E N - N E X T H O L D I N G S	16,500	2,757.00	45,490,500
ワイヤレスゲート	8,000	404.00	3,232,000
コネクシオ	10,000	1,506.00	15,060,000
クロップス	3,600	885.00	3,186,000
日本電信電話	2,026,500	2,844.00	5,763,366,000
K D D I	1,389,400	3,365.00	4,675,331,000
ソフトバンク	1,574,600	1,461.00	2,300,490,600
光通信	20,400	18,390.00	375,156,000
エムティーアイ	17,200	657.00	11,300,400
G M O インターネット	61,400	2,688.00	165,043,200
ファイバーゲート	5,900	1,511.00	8,914,900
アйдママーケティングコミュニケーション	5,500	376.00	2,068,000
K A D O K A W A	44,900	4,755.00	213,499,500
学研ホールディングス	24,600	1,184.00	29,126,400
ゼンリン	31,600	1,007.00	31,821,200
昭文社ホールディングス	7,700	493.00	3,796,100
インプレスホールディングス	14,300	226.00	3,231,800
アイネット	9,100	1,362.00	12,394,200
松竹	11,500	11,770.00	135,355,000
東宝	102,300	4,505.00	460,861,500
東映	5,700	19,340.00	110,238,000
エヌ・ティ・ティ・データ	461,400	1,817.00	838,363,800
ピー・シー・エー	2,600	5,270.00	13,702,000

ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,736.00	10,589,600
D T S	36,000	2,505.00	90,180,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	73,900	6,360.00	470,004,000
シーイーシー	18,700	1,537.00	28,741,900
カブコン	148,600	2,836.00	421,429,600
アイ・エス・ビー	8,300	1,131.00	9,387,300
ジャステック	10,300	1,200.00	12,360,000
S C S K	40,000	6,670.00	266,800,000
日本システムウエア	5,800	2,236.00	12,968,800
アイネス	17,200	1,376.00	23,667,200
T K C	29,400	3,640.00	107,016,000
富士ソフト	18,500	5,650.00	104,525,000
N S D	55,800	1,902.00	106,131,600
コナミホールディングス	63,000	6,420.00	404,460,000
福井コンピュータホールディングス	8,000	4,075.00	32,600,000
J B C Cホールディングス	11,900	1,434.00	17,064,600
ミロク情報サービス	17,300	1,432.00	24,773,600
ソフトバンクグループ	1,374,800	6,152.00	8,457,769,600
ハウスイ	1,400	907.00	1,269,800
高千穂交易	6,700	1,168.00	7,825,600
オルパヘルスケアホールディングス	2,900	1,605.00	4,654,500
伊藤忠食品	4,200	5,120.00	21,504,000
エレマテック	14,000	1,049.00	14,686,000
J A L U X	4,900	1,603.00	7,854,700
あらた	13,800	4,270.00	58,926,000
トーメンデバイス	2,200	4,585.00	10,087,000
東京エレクトロン デバイス	5,700	5,010.00	28,557,000
フィールズ	15,200	471.00	7,159,200
双日	960,400	311.00	298,684,400
アルフレッサ ホールディングス	180,400	1,722.00	310,648,800
横浜冷凍	48,800	909.00	44,359,200
ラサ商事	9,200	884.00	8,132,800
アルコニックス	18,500	1,512.00	27,972,000
神戸物産	135,000	4,225.00	570,375,000
ハイパー	4,400	528.00	2,323,200
あい ホールディングス	24,800	2,128.00	52,774,400
ディーブイエックス	5,400	1,007.00	5,437,800
ダイワボウホールディングス	79,200	1,948.00	154,281,600
マクニカ・富士エレホールディングス	41,500	2,377.00	98,645,500
ラクト・ジャパン	6,000	2,511.00	15,066,000
グリムス	5,200	2,729.00	14,190,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,300	787.00	23,846,100

八洲電機	13,500	950.00	12,825,000
メディアスホールディングス	9,900	848.00	8,395,200
レスターホールディングス	18,100	1,859.00	33,647,900
ジュテックホールディングス	4,000	1,054.00	4,216,000
大光	6,700	676.00	4,529,200
OCHIホールディングス	5,100	1,256.00	6,405,600
TOKAIホールディングス	84,300	897.00	75,617,100
黒谷	4,800	814.00	3,907,200
Cominix	3,100	712.00	2,207,200
三洋貿易	17,500	1,115.00	19,512,500
ビューティガレージ	2,800	4,190.00	11,732,000
ウイン・パートナーズ	12,600	992.00	12,499,200
ミタチ産業	4,800	717.00	3,441,600
シップヘルスケアホールディングス	61,300	2,645.00	162,138,500
明治電機工業	6,000	1,286.00	7,716,000
デリカフーズホールディングス	6,800	656.00	4,460,800
スターティアホールディングス	3,400	1,663.00	5,654,200
コメダホールディングス	37,900	2,003.00	75,913,700
ピーバンドットコム	2,400	671.00	1,610,400
アセンテック	4,500	1,154.00	5,193,000
富士興産	5,300	934.00	4,950,200
協栄産業	2,000	1,354.00	2,708,000
小野建	15,600	1,510.00	23,556,000
南陽	3,600	1,904.00	6,854,400
佐島電機	10,900	806.00	8,785,400
エコートレーディング	3,700	629.00	2,327,300
伯東	10,600	1,670.00	17,702,000
コンドーテック	13,500	992.00	13,392,000
中山福	10,100	412.00	4,161,200
ナガイレーベン	23,100	2,538.00	58,627,800
三菱食品	19,100	2,880.00	55,008,000
松田産業	12,700	2,388.00	30,327,600
第一興商	33,000	3,615.00	119,295,000
メディバルホールディングス	174,300	2,132.00	371,607,600
SPK	7,500	1,324.00	9,930,000
萩原電気ホールディングス	6,400	2,157.00	13,804,800
アズワン	12,500	15,410.00	192,625,000
スズデン	6,100	1,480.00	9,028,000
尾家産業	5,100	1,113.00	5,676,300
シモジマ	10,700	1,062.00	11,363,400
ドウシシャ	16,400	1,680.00	27,552,000
小津産業	3,800	1,895.00	7,201,000

高速	9,200	1,604.00	14,756,800
たけびし	6,100	1,536.00	9,369,600
リックス	3,900	1,534.00	5,982,600
丸文	15,400	663.00	10,210,200
ハピネット	14,500	1,410.00	20,445,000
橋本総業ホールディングス	3,500	2,700.00	9,450,000
日本ライフライン	56,200	1,334.00	74,970,800
タカショー	11,300	1,002.00	11,322,600
マルカ	6,200	2,584.00	16,020,800
I D O M	58,600	952.00	55,787,200
進和	10,300	2,242.00	23,092,600
エスケイジャパン	4,300	435.00	1,870,500
ダイトロン	7,400	2,016.00	14,918,400
シークス	24,900	1,189.00	29,606,100
田中商事	5,400	646.00	3,488,400
オーハシテクニカ	8,900	1,462.00	13,011,800
白銅	6,200	2,298.00	14,247,600
ダイコー通産	2,100	1,181.00	2,480,100
伊藤忠商事	1,216,300	3,235.00	3,934,730,500
丸紅	1,714,800	845.70	1,450,206,360
高島	2,800	1,766.00	4,944,800
長瀬産業	95,500	1,756.00	167,698,000
蝶理	11,100	1,812.00	20,113,200
豊田通商	174,700	4,740.00	828,078,000
三共生興	26,400	495.00	13,068,000
兼松	69,500	1,396.00	97,022,000
ツカモトコーポレーション	2,900	1,454.00	4,216,600
三井物産	1,387,200	2,320.00	3,218,304,000
日本紙パルプ商事	9,100	3,650.00	33,215,000
カメイ	22,700	1,138.00	25,832,600
東都水産	2,000	4,865.00	9,730,000
O U Gホールディングス	2,800	2,900.00	8,120,000
スターゼン	12,900	2,216.00	28,586,400
山善	68,000	1,038.00	70,584,000
椿本興業	3,200	3,660.00	11,712,000
住友商事	1,097,400	1,504.50	1,651,038,300
内田洋行	7,400	5,110.00	37,814,000
三菱商事	1,058,700	3,138.00	3,322,200,600
第一実業	7,900	4,700.00	37,130,000
キャノンマーケティングジャパン	43,100	2,468.00	106,370,800
西華産業	9,200	1,615.00	14,858,000
佐藤商事	14,400	1,125.00	16,200,000

菱洋エレクトロ	13,200	2,156.00	28,459,200
東京産業	15,800	678.00	10,712,400
ユアサ商事	17,800	2,926.00	52,082,800
神鋼商事	3,900	2,980.00	11,622,000
トルク	9,400	212.00	1,992,800
阪和興業	34,800	3,110.00	108,228,000
正栄食品工業	11,300	4,070.00	45,991,000
カナデン	14,100	1,018.00	14,353,800
菱電商事	12,500	1,737.00	21,712,500
フルサト工業	8,800	2,005.00	17,644,000
岩谷産業	41,700	5,890.00	245,613,000
ナイス	6,900	1,798.00	12,406,200
ニチモウ	2,700	1,981.00	5,348,700
極東貿易	5,000	2,278.00	11,390,000
アステナホールディングス	24,100	538.00	12,965,800
三愛石油	42,800	1,270.00	54,356,000
稲畑産業	41,800	1,623.00	67,841,400
G S I クレオス	8,500	953.00	8,100,500
明和産業	16,100	461.00	7,422,100
クワザワホールディングス	6,200	610.00	3,782,000
ヤマエ久野	12,700	1,072.00	13,614,400
ワキタ	34,300	995.00	34,128,500
東邦ホールディングス	55,800	1,881.00	104,959,800
サンゲツ	46,800	1,556.00	72,820,800
ミツウロコグループホールディングス	25,700	1,261.00	32,407,700
シナネンホールディングス	6,400	3,415.00	21,856,000
伊藤忠エネクス	38,500	960.00	36,960,000
サンリオ	48,800	2,116.00	103,260,800
サンワテクノス	11,500	1,269.00	14,593,500
リョーサン	19,200	2,072.00	39,782,400
新光商事	23,500	753.00	17,695,500
トーホー	7,900	1,556.00	12,292,400
三信電気	9,300	1,627.00	15,131,100
東陽テクニカ	17,200	1,098.00	18,885,600
モスフードサービス	24,600	3,130.00	76,998,000
加賀電子	15,700	2,685.00	42,154,500
ソーダニッカ	16,600	544.00	9,030,400
立花エレテック	12,900	1,450.00	18,705,000
フォーバル	6,100	970.00	5,917,000
P A L T A C	27,900	4,735.00	132,106,500
三谷産業	23,000	368.00	8,464,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,900	3,420.00	13,338,000

ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	1,794.00	2,870,400
コア商事ホールディングス	13,100	619.00	8,108,900
国際紙パルプ商事	37,200	296.00	11,011,200
ヤマタネ	7,500	1,552.00	11,640,000
丸紅建材リース	1,700	1,811.00	3,078,700
日鉄物産	12,400	4,725.00	58,590,000
泉州電業	4,900	3,965.00	19,428,500
トラスコ中山	36,200	2,894.00	104,762,800
オートバックスセブン	63,000	1,526.00	96,138,000
モリト	12,700	649.00	8,242,300
加藤産業	25,100	3,320.00	83,332,000
北恵	4,400	1,002.00	4,408,800
イノテック	9,800	1,333.00	13,063,400
イエローハット	32,900	1,911.00	62,871,900
J Kホールディングス	15,800	766.00	12,102,800
日伝	14,400	2,345.00	33,768,000
北沢産業	11,900	239.00	2,844,100
杉本商事	8,800	2,560.00	22,528,000
因幡電機産業	46,400	2,660.00	123,424,000
東テク	5,800	2,413.00	13,995,400
ミスミグループ本社	218,200	4,200.00	916,440,000
アルテック	11,800	317.00	3,740,600
タキヒヨー	5,800	1,750.00	10,150,000
蔵王産業	3,400	1,600.00	5,440,000
スズケン	73,700	3,290.00	242,473,000
ジェコス	12,000	866.00	10,392,000
グローセル	18,900	405.00	7,654,500
ローソン	44,000	5,800.00	255,200,000
サンエー	13,200	4,105.00	54,186,000
カワチ薬品	12,300	2,360.00	29,028,000
エービーシー・マート	27,200	5,870.00	159,664,000
ハードオフコーポレーション	8,100	761.00	6,164,100
アスクル	28,300	1,527.00	43,214,100
ゲオホールディングス	23,600	1,118.00	26,384,800
アダストリア	24,300	1,685.00	40,945,500
くら寿司	18,200	3,995.00	72,709,000
キャンドゥ	8,500	1,929.00	16,396,500
アイケイ	5,600	582.00	3,259,200
パルグループホールディングス	15,500	1,491.00	23,110,500
エディオン	74,100	1,021.00	75,656,100
サーラコーポレーション	35,900	596.00	21,396,400
ワッツ	8,800	900.00	7,920,000

ハローズ	7,100	2,935.00	20,838,500
フジオフードグループ本社	14,700	1,312.00	19,286,400
あみやき亭	3,900	2,857.00	11,142,300
大黒天物産	5,600	6,770.00	37,912,000
ハニーズホールディングス	14,100	1,061.00	14,960,100
ファーマライズホールディングス	4,700	748.00	3,515,600
アルペン	13,400	3,590.00	48,106,000
ハブ	6,100	656.00	4,001,600
クオールホールディングス	23,700	1,555.00	36,853,500
ジーンズホールディングス	11,900	6,980.00	83,062,000
ビックカメラ	103,500	1,063.00	110,020,500
D C Mホールディングス	107,600	1,081.00	116,315,600
MonotaRO	220,000	2,432.00	535,040,000
東京一番フーズ	5,100	585.00	2,983,500
きちりホールディングス	4,600	598.00	2,750,800
アークランドサービスホールディングス	12,900	2,173.00	28,031,700
J . フロント リテイリング	208,000	890.00	185,120,000
ドトール・日レスホールディングス	27,700	1,641.00	45,455,700
マツモトキヨシホールディングス	72,000	4,960.00	357,120,000
ブロンコビリー	10,100	2,353.00	23,765,300
Z O Z O	102,600	4,080.00	418,608,000
トレジャー・ファクトリー	5,500	830.00	4,565,000
物語コーポレーション	9,300	5,820.00	54,126,000
ココカラファイン	15,500	8,350.00	129,425,000
三越伊勢丹ホールディングス	304,800	701.00	213,664,800
H a m e e	4,700	1,583.00	7,440,100
マーケットエンタープライズ	1,600	744.00	1,190,400
ウエルシアホールディングス	92,000	4,110.00	378,120,000
クリエイティブSDホールディングス	25,700	3,855.00	99,073,500
丸善C H Iホールディングス	20,300	380.00	7,714,000
ミサワ	4,100	647.00	2,652,700
ティーライフ	2,600	1,376.00	3,577,600
チムニー	5,300	1,406.00	7,451,800
シュッピン	12,200	1,120.00	13,664,000
オイシックス・ラ・大地	23,000	3,620.00	83,260,000
ネクステージ	35,200	2,162.00	76,102,400
ジョイフル本田	51,200	1,436.00	73,523,200
鳥貴族ホールディングス	6,600	1,674.00	11,048,400
ホットランド	13,300	1,257.00	16,718,100
すかいらーくホールディングス	224,700	1,526.00	342,892,200
S F Pホールディングス	8,500	1,397.00	11,874,500
綿半ホールディングス	13,400	1,223.00	16,388,200

ヨシックスホールディングス	3,600	1,990.00	7,164,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,900	1,138.00	57,924,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,300	1,345.00	12,508,500
B E E N O S	8,900	3,090.00	27,501,000
あさひ	13,200	1,273.00	16,803,600
日本調剤	10,800	1,747.00	18,867,600
コスモス薬品	17,600	19,830.00	349,008,000
トーエル	8,900	849.00	7,556,100
オンリー	3,700	756.00	2,797,200
セブン&アイ・ホールディングス	680,300	4,905.00	3,336,871,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	93,500	898.00	83,963,000
ツルハホールディングス	38,000	14,180.00	538,840,000
サンマルクホールディングス	14,000	1,461.00	20,454,000
フェリシモ	4,100	1,406.00	5,764,600
トリドールホールディングス	43,300	2,064.00	89,371,200
T O K Y O B A S E	16,400	563.00	9,233,200
ウイルプラスホールディングス	3,100	934.00	2,895,400
J Mホールディングス	11,900	2,182.00	25,965,800
サツドラホールディングス	2,800	2,083.00	5,832,400
アレンザホールディングス	13,500	1,355.00	18,292,500
串カツ田中ホールディングス	4,800	1,885.00	9,048,000
パロックジャパンリミテッド	12,500	812.00	10,150,000
クスリのアオキホールディングス	17,300	7,960.00	137,708,000
力の源ホールディングス	7,900	593.00	4,684,700
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	101,900	4,085.00	416,261,500
メディカルシステムネットワーク	15,600	779.00	12,152,400
はるやまホールディングス	8,800	570.00	5,016,000
ノジマ	31,100	2,608.00	81,108,800
カップ・クリエイト	24,400	1,353.00	33,013,200
ライトオン	13,000	725.00	9,425,000
良品計画	200,300	2,211.00	442,863,300
三城ホールディングス	22,900	256.00	5,862,400
アドヴァングループ	18,100	867.00	15,692,700
アルピス	5,700	2,354.00	13,417,800
コナカ	20,500	344.00	7,052,000
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,635.00	3,924,000
G - 7ホールディングス	8,600	3,195.00	27,477,000
イオン北海道	23,100	1,103.00	25,479,300
コジマ	30,500	642.00	19,581,000
ヒマラヤ	6,400	1,268.00	8,115,200

コーナン商事	24,800	3,760.00	93,248,000
エコス	6,600	1,904.00	12,566,400
ワタミ	22,900	941.00	21,548,900
マルシェ	4,600	474.00	2,180,400
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	347,700	2,131.00	740,948,700
西松屋チェーン	38,400	1,337.00	51,340,800
ゼンショーホールディングス	93,500	2,773.00	259,275,500
幸楽苑ホールディングス	11,000	1,460.00	16,060,000
ハークスレイ	4,000	947.00	3,788,000
サイゼリヤ	25,900	2,400.00	62,160,000
V Tホールディングス	66,200	529.00	35,019,800
魚力	5,600	2,040.00	11,424,000
フジ・コーポレーション	9,500	1,137.00	10,801,500
ユナイテッドアローズ	20,100	1,641.00	32,984,100
ハイデイ日高	25,300	1,667.00	42,175,100
京都きもの友禅	12,600	247.00	3,112,200
コロワイド	57,800	2,015.00	116,467,000
ピーシーデポコーポレーション	21,000	448.00	9,408,000
壱番屋	12,300	4,870.00	59,901,000
P L A N T	5,000	705.00	3,525,000
スギホールディングス	34,800	8,860.00	308,328,000
薬王堂ホールディングス	7,700	2,483.00	19,119,100
スクロール	25,300	801.00	20,265,300
ヨンドシーホールディングス	16,200	1,740.00	28,188,000
木曽路	22,900	2,297.00	52,601,300
S R Sホールディングス	23,300	805.00	18,756,500
リテールパートナーズ	21,400	1,260.00	26,964,000
ケーヨー	32,300	800.00	25,840,000
上新電機	20,100	2,345.00	47,134,500
日本瓦斯	84,800	1,453.00	123,214,400
ロイヤルホールディングス	29,800	1,912.00	56,977,600
いなげや	19,500	1,472.00	28,704,000
チヨダ	17,400	802.00	13,954,800
ライフコーポレーション	16,300	4,385.00	71,475,500
リンガーハット	21,400	2,322.00	49,690,800
M r M a x H D	24,500	623.00	15,263,500
A O K Iホールディングス	34,200	598.00	20,451,600
オークワ	27,400	1,137.00	31,153,800
コメリ	27,000	2,516.00	67,932,000
青山商事	39,200	608.00	23,833,600
しまむら	20,300	9,750.00	197,925,000
はせがわ	10,600	272.00	2,883,200

高島屋	126,800	1,067.00	135,295,600
松屋	38,200	855.00	32,661,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	82,600	786.00	64,923,600
近鉄百貨店	6,800	2,368.00	16,102,400
丸井グループ	147,200	1,855.00	273,056,000
アクシアル リテイリング	14,500	3,945.00	57,202,500
イオン	669,200	3,022.00	2,022,322,400
イズミ	35,400	3,560.00	126,024,000
平和堂	32,200	2,170.00	69,874,000
フジ	21,100	1,948.00	41,102,800
ヤオコー	19,800	7,180.00	142,164,000
ゼビオホールディングス	21,400	1,039.00	22,234,600
ケーズホールディングス	148,300	1,111.00	164,761,300
Olympicグループ	9,500	764.00	7,258,000
日産東京販売ホールディングス	27,200	228.00	6,201,600
シルバーライフ	3,700	1,845.00	6,826,500
Genky DrugStores	7,700	4,455.00	34,303,500
ナルミヤ・インターナショナル	3,700	890.00	3,293,000
ブックオフグループホールディングス	10,100	936.00	9,453,600
ギフト	2,900	2,033.00	5,895,700
アインホールディングス	25,300	7,210.00	182,413,000
元気寿司	5,000	2,475.00	12,375,000
ヤマダホールディングス	583,700	469.00	273,755,300
アークランドサカモト	27,500	1,502.00	41,305,000
ニトリホールディングス	69,000	21,380.00	1,475,220,000
グルメ杵屋	12,800	973.00	12,454,400
愛眼	13,900	222.00	3,085,800
ケーユーホールディングス	9,500	1,007.00	9,566,500
吉野家ホールディングス	57,300	2,073.00	118,782,900
松屋フーズホールディングス	8,500	3,585.00	30,472,500
サガミホールディングス	25,700	1,027.00	26,393,900
関西スーパーマーケット	13,400	1,279.00	17,138,600
王将フードサービス	11,600	5,910.00	68,556,000
プレナス	19,700	2,026.00	39,912,200
ミニストップ	13,000	1,442.00	18,746,000
アークス	33,400	2,342.00	78,222,800
バローホールディングス	35,700	2,484.00	88,678,800
ベルク	8,600	5,920.00	50,912,000
大庄	9,700	991.00	9,612,700
ファーストリテイリング	23,300	72,050.00	1,678,765,000
サンドラッグ	65,500	3,735.00	244,642,500
サクスパー ホールディングス	15,400	534.00	8,223,600

ヤマザワ	4,300	1,729.00	7,434,700
やまや	3,600	2,382.00	8,575,200
ベルーナ	37,800	775.00	29,295,000
島根銀行	6,000	568.00	3,408,000
じもとホールディングス	11,800	680.00	8,024,000
めぶきフィナンシャルグループ	904,800	241.00	218,056,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,800	1,562.00	34,051,600
九州フィナンシャルグループ	355,600	407.00	144,729,200
ゆうちょ銀行	493,300	951.00	469,128,300
富山第一銀行	41,500	282.00	11,703,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,060,900	429.00	455,126,100
西日本フィナンシャルホールディングス	113,700	684.00	77,770,800
三十三フィナンシャルグループ	15,100	1,437.00	21,698,700
第四北越フィナンシャルグループ	28,300	2,563.00	72,532,900
ひろぎんホールディングス	256,800	616.00	158,188,800
新生銀行	142,000	1,421.00	201,782,000
あおぞら銀行	103,700	2,549.00	264,331,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,912,300	589.40	7,021,109,620
りそなホールディングス	2,009,600	419.20	842,424,320
三井住友トラスト・ホールディングス	329,200	3,554.00	1,169,976,800
三井住友フィナンシャルグループ	1,205,100	3,730.00	4,495,023,000
千葉銀行	581,200	674.00	391,728,800
群馬銀行	358,400	357.00	127,948,800
武蔵野銀行	25,900	1,705.00	44,159,500
千葉興業銀行	44,300	261.00	11,562,300
筑波銀行	72,400	171.00	12,380,400
七十七銀行	54,600	1,204.00	65,738,400
青森銀行	13,500	2,027.00	27,364,500
秋田銀行	10,400	1,413.00	14,695,200
山形銀行	19,600	842.00	16,503,200
岩手銀行	11,400	1,643.00	18,730,200
東邦銀行	155,700	212.00	33,008,400
東北銀行	8,300	999.00	8,291,700
みちのく銀行	11,200	912.00	10,214,400
ふくおかフィナンシャルグループ	157,200	2,013.00	316,443,600
静岡銀行	424,100	857.00	363,453,700
十六銀行	21,800	2,118.00	46,172,400
スルガ銀行	152,700	355.00	54,208,500
八十二銀行	392,200	371.00	145,506,200
山梨中央銀行	20,200	809.00	16,341,800
大垣共立銀行	34,400	1,870.00	64,328,000
福井銀行	14,900	1,454.00	21,664,600

北國銀行	16,200	2,013.00	32,610,600	
清水銀行	7,200	1,599.00	11,512,800	
富山銀行	3,400	1,895.00	6,443,000	
滋賀銀行	34,900	1,830.00	63,867,000	
南都銀行	25,300	1,948.00	49,284,400	
百五銀行	156,700	312.00	48,890,400	
京都銀行	62,400	4,795.00	299,208,000	
紀陽銀行	61,700	1,518.00	93,660,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	115,900	826.00	95,733,400	
山陰合同銀行	109,700	567.00	62,199,900	
中国銀行	149,900	857.00	128,464,300	
鳥取銀行	5,500	1,112.00	6,116,000	
伊予銀行	230,700	572.00	131,960,400	
百十四銀行	18,500	1,552.00	28,712,000	
四国銀行	24,700	707.00	17,462,900	
阿波銀行	26,700	2,111.00	56,363,700	
大分銀行	10,000	1,741.00	17,410,000	
宮崎銀行	10,900	2,001.00	21,810,900	
佐賀銀行	9,900	1,395.00	13,810,500	
沖縄銀行	15,900	2,605.00	41,419,500	
琉球銀行	37,800	781.00	29,521,800	
セブン銀行	581,800	249.00	144,868,200	
みずほフィナンシャルグループ	2,366,300	1,551.00	3,670,131,300	
高知銀行	6,300	772.00	4,863,600	
山口フィナンシャルグループ	217,400	635.00	138,049,000	
長野銀行	5,700	1,123.00	6,401,100	
名古屋銀行	14,000	2,451.00	34,314,000	
北洋銀行	262,500	249.00	65,362,500	
愛知銀行	5,800	3,325.00	19,285,000	
中京銀行	6,300	1,345.00	8,473,500	
大光銀行	6,000	1,292.00	7,752,000	
愛媛銀行	24,300	765.00	18,589,500	
トマト銀行	6,700	1,053.00	7,055,100	
京葉銀行	74,300	428.00	31,800,400	
栃木銀行	84,100	170.00	14,297,000	
北日本銀行	5,400	1,566.00	8,456,400	
東和銀行	30,600	502.00	15,361,200	
福島銀行	20,000	236.00	4,720,000	
大東銀行	8,400	612.00	5,140,800	
トモニホールディングス	134,600	311.00	41,860,600	
フィデアホールディングス	169,100	121.00	20,461,100	
池田泉州ホールディングス	200,300	162.00	32,448,600	

F P G	59,000	632.00	37,288,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,600	1,273.00	17,312,800
マーキュリアホールディングス	6,200	721.00	4,470,200
S B I ホールディングス	214,700	2,571.00	551,993,700
ジャフコ グループ	22,200	6,320.00	140,304,000
大和証券グループ本社	1,304,600	582.30	759,668,580
野村ホールディングス	2,659,300	519.80	1,382,304,140
岡三証券グループ	149,000	387.00	57,663,000
丸三証券	52,200	606.00	31,633,200
東洋証券	59,300	139.00	8,242,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	186,400	390.00	72,696,000
光世証券	4,700	539.00	2,533,300
水戸証券	47,400	287.00	13,603,800
いちよし証券	35,300	590.00	20,827,000
松井証券	85,600	799.00	68,394,400
マネックスグループ	156,600	600.00	93,960,000
極東証券	23,700	763.00	18,083,100
岩井コスモホールディングス	18,000	1,331.00	23,958,000
藍澤証券	31,500	940.00	29,610,000
マネーパートナーズグループ	19,900	192.00	3,820,800
スパークス・グループ	81,500	257.00	20,945,500
かんぽ生命保険	215,900	1,913.00	413,016,700
S O M P O ホールディングス	307,000	4,732.00	1,452,724,000
アニコム ホールディングス	49,000	894.00	43,806,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	422,900	3,503.00	1,481,418,700
第一生命ホールディングス	857,100	2,133.50	1,828,622,850
東京海上ホールディングス	573,500	5,302.00	3,040,697,000
T & D ホールディングス	520,500	1,315.00	684,457,500
アドバンスクリエイト	8,300	906.00	7,519,800
全国保証	45,400	5,070.00	230,178,000
あんしん保証	7,300	290.00	2,117,000
イントラスト	5,500	632.00	3,476,000
日本モーゲージサービス	9,300	1,030.00	9,579,000
C a s a	5,300	910.00	4,823,000
アルヒ	26,000	1,262.00	32,812,000
プレミアグループ	8,200	3,080.00	25,256,000
クレディセゾン	102,000	1,181.00	120,462,000
芙蓉総合リース	18,300	7,120.00	130,296,000
みずほリース	27,000	3,430.00	92,610,000
東京センチュリー	40,500	5,630.00	228,015,000
日本証券金融	74,200	812.00	60,250,400
アイフル	293,400	330.00	96,822,000

リコーリース	13,800	3,495.00	48,231,000
イオンフィナンシャルサービス	106,900	1,244.00	132,983,600
アコム	344,500	427.00	147,101,500
ジャックス	19,400	2,607.00	50,575,800
オリエントコーポレーション	473,900	142.00	67,293,800
オリックス	1,057,400	1,967.50	2,080,434,500
三菱HCキャピタル	603,000	577.00	347,931,000
九州リースサービス	9,300	550.00	5,115,000
日本取引所グループ	470,600	2,589.00	1,218,383,400
イー・ギャランティ	20,600	2,184.00	44,990,400
アサックス	9,600	692.00	6,643,200
NECキャピタルソリューション	7,300	2,034.00	14,848,200
いちご	199,500	335.00	66,832,500
日本駐車場開発	202,600	159.00	32,213,400
スター・マイカ・ホールディングス	10,900	1,243.00	13,548,700
SREホールディングス	2,800	6,110.00	17,108,000
ADワークスグループ	34,200	154.00	5,266,800
ヒューリック	370,900	1,248.00	462,883,200
三栄建築設計	7,900	1,788.00	14,125,200
野村不動産ホールディングス	100,600	2,772.00	278,863,200
三重交通グループホールディングス	39,200	471.00	18,463,200
サムティ	25,600	2,261.00	57,881,600
ディア・ライフ	26,300	462.00	12,150,600
日本商業開発	12,200	1,660.00	20,252,000
プレサンスコーポレーション	29,800	1,615.00	48,127,000
ハウスコム	4,600	1,220.00	5,612,000
日本管理センター	9,800	1,173.00	11,495,400
サンセイランディック	7,400	778.00	5,757,200
フージャースホールディングス	28,400	640.00	18,176,000
オープンハウス	55,600	4,790.00	266,324,000
東急不動産ホールディングス	476,600	583.00	277,857,800
飯田グループホールディングス	146,000	2,518.00	367,628,000
イーランド	4,300	1,268.00	5,452,400
ムゲンエステート	14,600	470.00	6,862,000
ハウズドゥ	8,600	1,005.00	8,643,000
シーアールイー	5,700	1,603.00	9,137,100
グッドコムアセット	8,800	1,300.00	11,440,000
ジェイ・エス・ビー	4,100	3,345.00	13,714,500
テンポイノベーション	7,000	869.00	6,083,000
フェイスネットワーク	2,800	1,322.00	3,701,600
パーク24	94,400	1,876.00	177,094,400
パラカ	5,600	1,703.00	9,536,800

三井不動産	794,400	2,407.00	1,912,120,800
三菱地所	1,145,100	1,678.50	1,922,050,350
平和不動産	30,300	4,120.00	124,836,000
東京建物	173,100	1,604.00	277,652,400
ダイビル	45,500	1,371.00	62,380,500
京阪神ビルディング	31,300	1,415.00	44,289,500
住友不動産	392,000	3,392.00	1,329,664,000
テーオーシー	37,100	626.00	23,224,600
東京楽天地	3,300	3,975.00	13,117,500
スターツコーポレーション	21,400	2,785.00	59,599,000
フジ住宅	23,000	657.00	15,111,000
空港施設	20,700	557.00	11,529,900
明和地所	11,300	598.00	6,757,400
ゴールドクレスト	16,800	1,629.00	27,367,200
エスリード	8,000	1,519.00	12,152,000
日神グループホールディングス	29,500	481.00	14,189,500
日本エスコン	32,400	750.00	24,300,000
タカラレーベン	73,000	314.00	22,922,000
A V A N T I A	11,000	904.00	9,944,000
イオンモール	88,400	1,629.00	144,003,600
毎日コムネット	8,400	748.00	6,283,200
ファースト住建	8,000	1,185.00	9,480,000
カチタス	43,600	3,450.00	150,420,000
トーセイ	25,600	1,125.00	28,800,000
穴吹興産	4,800	1,892.00	9,081,600
サンフロンティア不動産	23,100	1,060.00	24,486,000
エフ・ジェー・ネクスト	18,900	1,011.00	19,107,900
インテリックス	3,900	691.00	2,694,900
ランドビジネス	7,300	265.00	1,934,500
サンネクスタグループ	7,400	976.00	7,222,400
グランディハウス	15,900	456.00	7,250,400
日本空港ビルデング	60,900	4,610.00	280,749,000
明豊ファシリティワークス	8,000	908.00	7,264,000
日本工営	10,000	3,005.00	30,050,000
L I F U L L	52,400	320.00	16,768,000
ミクシィ	43,000	2,432.00	104,576,000
ジェイエイシーリクルートメント	14,100	1,700.00	23,970,000
日本M&Aセンター	276,800	3,120.00	863,616,000
メンバーズ	5,100	2,893.00	14,754,300
中広	3,100	377.00	1,168,700
UTグループ	24,400	2,780.00	67,832,000
アイティメディア	5,800	2,122.00	12,307,600

タケエイ	19,000	1,493.00	28,367,000
E・Jホールディングス	9,100	1,187.00	10,801,700
夢真ビーネックスグループ	45,200	1,095.00	49,494,000
コシダカホールディングス	45,700	520.00	23,764,000
アルトナー	4,500	793.00	3,568,500
パソナグループ	18,400	2,381.00	43,810,400
C D S	4,400	1,613.00	7,097,200
リンクアンドモチベーション	37,200	958.00	35,637,600
G C A	24,800	1,377.00	34,149,600
エス・エム・エス	57,400	3,735.00	214,389,000
サニーサイドアップグループ	6,200	701.00	4,346,200
パーソルホールディングス	168,800	2,505.00	422,844,000
リニカル	9,800	807.00	7,908,600
クックパッド	54,300	221.00	12,000,300
アイ・ケイ・ケイ	8,700	664.00	5,776,800
学情	7,100	1,104.00	7,838,400
スタジオアリス	8,600	2,309.00	19,857,400
シミックホールディングス	9,500	1,406.00	13,357,000
エプコ	4,000	794.00	3,176,000
N J S	3,900	1,838.00	7,168,200
総合警備保障	67,200	5,210.00	350,112,000
カカクコム	124,700	3,175.00	395,922,500
アイロムグループ	6,100	1,875.00	11,437,500
セントケア・ホールディング	12,700	854.00	10,845,800
サイネックス	3,300	653.00	2,154,900
ルネサンス	10,800	1,100.00	11,880,000
ディップ	26,500	3,085.00	81,752,500
デジタルホールディングス	11,900	1,619.00	19,266,100
新日本科学	20,900	824.00	17,221,600
キャリアデザインセンター	4,500	1,077.00	4,846,500
ベネフィット・ワン	61,500	4,015.00	246,922,500
エムスリー	297,700	7,038.00	2,095,212,600
ツカダ・グローバルホールディング	10,700	294.00	3,145,800
アウトソーシング	96,800	1,659.00	160,591,200
ウェルネット	17,600	466.00	8,201,600
ワールドホールディングス	6,900	2,484.00	17,139,600
ディー・エヌ・エー	71,500	1,893.00	135,349,500
博報堂D Yホールディングス	235,000	1,682.00	395,270,000
ぐるなび	30,000	425.00	12,750,000
タカミヤ	21,100	450.00	9,495,000
ジャパンベストレスキューシステム	11,400	1,038.00	11,833,200
ファンコミュニケーションズ	42,900	399.00	17,117,100

ライク	4,600	1,751.00	8,054,600
ビジネス・ブレイクスルー	7,800	401.00	3,127,800
エスプール	48,000	884.00	42,432,000
WDBホールディングス	7,800	3,240.00	25,272,000
手間いらず	2,200	4,830.00	10,626,000
ティア	10,400	502.00	5,220,800
CDG	1,700	1,583.00	2,691,100
アドウェイズ	27,900	631.00	17,604,900
バリューコマース	13,300	4,025.00	53,532,500
インフォマート	185,200	888.00	164,457,600
J Pホールディングス	49,300	264.00	13,015,200
エコナックホールディングス	33,900	85.00	2,881,500
レグス	3,700	2,025.00	7,492,500
プレステージ・インターナショナル	63,600	747.00	47,509,200
アミューズ	9,300	2,277.00	21,176,100
ドリームインキュベータ	5,500	821.00	4,515,500
クイック	10,700	1,249.00	13,364,300
TAC	10,500	231.00	2,425,500
電通グループ	174,000	3,920.00	682,080,000
イオンファンタジー	6,700	1,710.00	11,457,000
シーティーエス	19,400	718.00	13,929,200
ネクシィーズグループ	6,200	827.00	5,127,400
H.U.グループホールディングス	47,300	3,175.00	150,177,500
アルプス技研	15,100	1,876.00	28,327,600
ダイオーズ	3,600	1,046.00	3,765,600
日本空調サービス	18,100	702.00	12,706,200
オリエンタルランド	179,400	15,645.00	2,806,713,000
ダスキン	39,300	2,604.00	102,337,200
明光ネットワークジャパン	20,300	589.00	11,956,700
ファルコホールディングス	8,200	1,757.00	14,407,400
ラウンドワン	57,800	1,072.00	61,961,600
リゾートトラスト	77,500	1,681.00	130,277,500
ビー・エム・エル	21,800	4,590.00	100,062,000
りらいあコミュニケーションズ	25,900	1,185.00	30,691,500
リソー教育	86,400	389.00	33,609,600
早稲田アカデミー	7,500	916.00	6,870,000
ユー・エス・エス	189,000	1,826.00	345,114,000
東京個別指導学院	15,400	589.00	9,070,600
サイバーエージェント	416,000	1,926.00	801,216,000
楽天グループ	865,400	1,050.00	908,670,000
クリーク・アンド・リバー社	9,000	1,636.00	14,724,000
モーニングスター	25,200	461.00	11,617,200

テー・オー・ダブリュー	30,500	300.00	9,150,000
山田コンサルティンググループ	10,100	1,028.00	10,382,800
セントラルスポーツ	6,400	2,261.00	14,470,400
フルキャストホールディングス	14,500	2,066.00	29,957,000
エン・ジャパン	30,100	3,435.00	103,393,500
リソルホールディングス	1,900	3,930.00	7,467,000
テクノプロ・ホールディングス	101,100	2,804.00	283,484,400
アトラグループ	3,700	297.00	1,098,900
インターワークス	5,600	382.00	2,139,200
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	11,950.00	82,455,000
K e e P e r 技研	10,900	3,285.00	35,806,500
ファーストロジック	3,600	750.00	2,700,000
三機サービス	3,500	1,080.00	3,780,000
G u n o s y	11,000	637.00	7,007,000
デザインワン・ジャパン	5,500	217.00	1,193,500
イー・ガーディアン	6,900	3,005.00	20,734,500
リブセンス	10,800	200.00	2,160,000
ジャパンマテリアル	52,100	1,180.00	61,478,000
ベクトル	21,300	909.00	19,361,700
ウチヤマホールディングス	9,200	317.00	2,916,400
チャーム・ケア・コーポレーション	12,800	1,530.00	19,584,000
キャリアリンク	5,700	1,731.00	9,866,700
I B J	14,100	872.00	12,295,200
アサンテ	6,300	1,708.00	10,760,400
バリューHR	6,900	1,517.00	10,467,300
M & A キャピタルパートナーズ	14,000	4,925.00	68,950,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,700	1,461.00	9,788,700
E R I ホールディングス	5,000	925.00	4,625,000
アビスト	2,700	2,915.00	7,870,500
シグマクシス	9,400	2,131.00	20,031,400
ウィルグループ	12,600	1,170.00	14,742,000
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	26,500	196.00	5,194,000
メドピア	13,100	3,815.00	49,976,500
レアジョブ	3,400	1,237.00	4,205,800
リクルートホールディングス	1,208,600	6,076.00	7,343,453,600
エラン	23,500	1,105.00	25,967,500
土木管理総合試験所	8,600	360.00	3,096,000
ネットマーケティング	9,000	393.00	3,537,000
日本郵政	1,276,900	930.20	1,187,772,380
ベルシステム24ホールディングス	28,500	1,571.00	44,773,500
鎌倉新書	17,300	989.00	17,109,700
S M N	4,100	625.00	2,562,500

グローバルキッズCOMPANY	3,500	673.00	2,355,500	
エアトリ	10,800	2,212.00	23,889,600	
アトラエ	11,800	2,223.00	26,231,400	
ストライク	6,400	3,650.00	23,360,000	
ソラスト	41,600	1,358.00	56,492,800	
セラク	5,500	1,901.00	10,455,500	
インソース	16,500	1,850.00	30,525,000	
ベikalレント・コンサルティング	11,100	48,300.00	536,130,000	
Orchestra Holdings	3,300	2,688.00	8,870,400	
アイモバイル	5,000	1,318.00	6,590,000	
キャリアインデックス	7,200	893.00	6,429,600	
MS - Japan	7,100	1,001.00	7,107,100	
船場	3,700	818.00	3,026,600	
グレイステクノロジー	17,500	1,028.00	17,990,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,800	2,587.00	126,245,600	
フルテック	2,600	1,285.00	3,341,000	
GameWith	5,600	493.00	2,760,800	
ソウルドアウト	4,200	1,714.00	7,198,800	
MS&Consulting	3,200	567.00	1,814,400	
ウェルビー	6,500	1,340.00	8,710,000	
エル・ティー・エス	2,200	3,260.00	7,172,000	
ミダック	7,400	4,055.00	30,007,000	
日総工産	13,600	722.00	9,819,200	
キュービーネットホールディングス	7,900	1,662.00	13,129,800	
RPAホールディングス	20,800	576.00	11,980,800	
スプリックス	5,100	873.00	4,452,300	
マネジメントソリューションズ	8,400	2,558.00	21,487,200	
プロレド・パートナーズ	3,800	2,270.00	8,626,000	
テノ・ホールディングス	2,400	857.00	2,056,800	
フロンティア・マネジメント	4,700	893.00	4,197,100	
ピアラ	3,100	792.00	2,455,200	
コプロ・ホールディングス	2,500	1,141.00	2,852,500	
ギークス	3,100	1,416.00	4,389,600	
カーブスホールディングス	46,700	734.00	34,277,800	
フォーラムエンジニアリング	12,100	856.00	10,357,600	
ダイレクトマーケティングミックス	9,100	3,555.00	32,350,500	
ポピンズホールディングス	4,000	2,813.00	11,252,000	
LITALICO	6,900	4,640.00	32,016,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	8,800	1,074.00	9,451,200	
リログループ	92,300	2,301.00	212,382,300	
東祥	10,700	1,548.00	16,563,600	
エイチ・アイ・エス	37,200	2,164.00	80,500,800	

ラックランド	4,900	2,725.00	13,352,500	
共立メンテナンス	28,000	3,410.00	95,480,000	
イチネンホールディングス	17,800	1,207.00	21,484,600	
建設技術研究所	10,200	2,365.00	24,123,000	
スペース	12,400	902.00	11,184,800	
長大	6,900	1,842.00	12,709,800	
燦ホールディングス	7,500	1,405.00	10,537,500	
スバル興業	1,100	7,880.00	8,668,000	
東京テアトル	6,600	1,230.00	8,118,000	
タナベ経営	3,400	1,500.00	5,100,000	
ナガワ	5,400	9,100.00	49,140,000	
東京都競馬	12,700	3,900.00	49,530,000	
カナモト	29,900	2,495.00	74,600,500	
西尾レントオール	15,700	2,757.00	43,284,900	
トランス・コスモス	16,100	3,265.00	52,566,500	
乃村工藝社	72,600	851.00	61,782,600	
藤田観光	7,400	2,125.00	15,725,000	
KNT-CTホールディングス	9,000	1,214.00	10,926,000	
日本管財	18,200	2,557.00	46,537,400	
トーカイ	16,400	2,375.00	38,950,000	
セコム	166,300	8,390.00	1,395,257,000	
セントラル警備保障	8,200	2,553.00	20,934,600	
丹青社	32,200	810.00	26,082,000	
メイテック	20,400	6,220.00	126,888,000	
応用地質	19,200	1,246.00	23,923,200	
船井総研ホールディングス	34,700	2,607.00	90,462,900	
進学会ホールディングス	7,300	412.00	3,007,600	
オオバ	12,200	770.00	9,394,000	
いであ	4,700	1,804.00	8,478,800	
学究社	5,100	1,370.00	6,987,000	
ベネッセホールディングス	62,000	2,335.00	144,770,000	
イオンディライト	20,900	3,565.00	74,508,500	
ナック	8,300	927.00	7,694,100	
ダイセキ	28,300	5,000.00	141,500,000	
ステップ	6,300	1,703.00	10,728,900	
合計	184,977,200		455,190,676,900	

(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
新株予約権証券	富士興産株式会社第1回A新株予約権	5,300	-	

合計	5,300	-	
----	-------	---	--

(注) 券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2021年 8月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,666,572,468
国債証券	548,750,299,000
地方債証券	35,934,027,134
特殊債証券	39,986,307,467
社債証券	29,662,983,220
未収入金	605,979,000
未収利息	1,362,610,722
前払費用	43,361,124
流動資産合計	664,012,140,135
資産合計	664,012,140,135
負債の部	
流動負債	
未払金	7,881,950,800
未払解約金	177,710,904
未払利息	13,749
流動負債合計	8,059,675,453
負債合計	8,059,675,453
純資産の部	
元本等	
元本	463,227,658,646
剰余金	
剰余金又は欠損金()	192,724,806,036
元本等合計	655,952,464,682
純資産合計	655,952,464,682
負債純資産合計	664,012,140,135

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2021年 8月20日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2021年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	463,227,658,646口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 101,524,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.4160円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,160円)</p>

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

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

2021年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2021年 8月20日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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	2021年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月21日
期首元本額	392,109,031,403円
期中追加設定元本額	89,845,134,285円
期中一部解約元本額	18,726,507,042円
期末元本額	463,227,658,646円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,780,580,156円
S B I 資産設計オープン（分配型）	13,629,697円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,808,216,364円
世界経済インデックスファンド	2,736,959,675円
D C マイセレクション 2 5	24,488,969,188円
D C マイセレクション 5 0	27,762,632,282円
D C マイセレクション 7 5	8,089,441,985円
D C 日本債券インデックス・オープン	436,333,343円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,564,547,319円
D C 日本債券インデックス・オープン P	68,601,873,085円
D C マイセレクション S 2 5	11,609,594,725円
D C マイセレクション S 5 0	12,884,326,384円
D C マイセレクション S 7 5	2,713,289,952円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	985,711,059円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,948,299,002円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	697,948,841円
D C 世界経済インデックスファンド	3,007,306,684円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	15,109,210円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,651,160円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	39,181,171円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	9,005,829円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,015,770円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	122,257,073円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	191,259,171円

区分	2021年 8月20日現在
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	38,523,386円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	34,183,244円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,364,619,862円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	806,746,301円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,404,911,796円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	254,257,258円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	84,732,368円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,086,668,214円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,228,794,332円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,530,770,275円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	146,833,416円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,980,597,781円
日本債券ファンド・シリーズ1	14,758,379,775円
分散投資コア戦略ファンドA	30,398,694,108円
分散投資コア戦略ファンドS	36,159,801,158円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	133,283,212円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,250,213,454円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	57,923,976円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	33,993,092円
SMT インデックスバランス・オープン	57,892,605円
SMT 世界経済インデックス・オープン	25,900,479円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	47,315,823円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	75,752,544円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,095,303円
グローバル経済コア	194,594,818円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	22,921,458円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	12,906,258円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	6,538,492円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	3,457,767円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,037,216円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	483,932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）	78,454,299,238円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	51,080,999円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,068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）	81,273円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 8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	2,273,525,800

地方債証券	78,682,023
特殊債券	76,242,852
社債券	88,192,060
合計	2,516,642,735

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第4 1 6 回利付国債(2年)	4,530,000,000	4,541,370,300	
	第4 1 7 回利付国債(2年)	3,240,000,000	3,248,974,800	
	第4 1 8 回利付国債(2年)	1,040,000,000	1,043,099,200	
	第4 1 9 回利付国債(2年)	570,000,000	571,818,300	
	第4 2 0 回利付国債(2年)	1,250,000,000	1,254,250,000	
	第4 2 1 回利付国債(2年)	590,000,000	592,129,900	
	第4 2 2 回利付国債(2年)	130,000,000	130,495,300	
	第4 2 3 回利付国債(2年)	410,000,000	411,020,900	
	第4 2 4 回利付国債(2年)	570,000,000	571,493,400	
	第4 2 5 回利付国債(2年)	2,870,000,000	2,877,892,500	
	第4 2 6 回利付国債(2年)	620,000,000	621,785,600	
	第4 2 7 回利付国債(2年)	3,090,000,000	3,098,991,900	
	第1 3 3 回利付国債(5年)	4,380,000,000	4,391,081,400	
	第1 3 4 回利付国債(5年)	5,700,000,000	5,718,126,000	
	第1 3 5 回利付国債(5年)	4,080,000,000	4,095,748,800	
	第1 3 6 回利付国債(5年)	4,400,000,000	4,419,316,000	
	第1 3 7 回利付国債(5年)	6,760,000,000	6,793,732,400	
	第1 3 8 回利付国債(5年)	6,880,000,000	6,918,528,000	
	第1 3 9 回利付国債(5年)	5,690,000,000	5,725,960,800	
	第1 4 0 回利付国債(5年)	6,300,000,000	6,342,840,000	

第141回利付国債(5年)	7,750,000,000	7,807,427,500	
第142回利付国債(5年)	5,380,000,000	5,423,093,800	
第143回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,841,328,000	
第144回利付国債(5年)	6,310,000,000	6,368,178,200	
第145回利付国債(5年)	8,240,000,000	8,321,081,600	
第146回利付国債(5年)	2,590,000,000	2,617,039,600	
第147回利付国債(5年)	5,450,000,000	5,485,098,000	
第148回利付国債(5年)	2,650,000,000	2,667,357,500	
第1回利付国債(40年)	400,000,000	583,052,000	
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,595,492,200	
第3回利付国債(40年)	550,000,000	778,888,000	
第4回利付国債(40年)	1,200,000,000	1,703,616,000	
第5回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,468,361,000	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,701,567,000	
第7回利付国債(40年)	1,040,000,000	1,351,708,800	
第8回利付国債(40年)	1,230,000,000	1,496,590,200	
第9回利付国債(40年)	1,560,000,000	1,425,746,400	
第10回利付国債(40年)	2,370,000,000	2,530,212,000	
第11回利付国債(40年)	1,790,000,000	1,852,900,600	
第12回利付国債(40年)	1,710,000,000	1,598,747,400	
第13回利付国債(40年)	2,040,000,000	1,898,770,800	
第14回利付国債(40年)	640,000,000	636,057,600	
第325回利付国債(10年)	4,590,000,000	4,636,267,200	
第326回利付国債(10年)	3,120,000,000	3,154,600,800	
第327回利付国債(10年)	3,190,000,000	3,229,619,800	
第328回利付国債(10年)	4,150,000,000	4,198,389,000	
第329回利付国債(10年)	3,810,000,000	3,875,151,000	
第330回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,936,993,000	
第331回利付国債(10年)	900,000,000	913,770,000	
第332回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,882,320,000	
第333回利付国債(10年)	3,030,000,000	3,087,479,100	
第334回利付国債(10年)	4,860,000,000	4,961,962,800	
第335回利付国債(10年)	2,370,000,000	2,416,854,900	
第336回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,072,449,000	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,841,160,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,648,372,800	
第339回利付国債(10年)	4,750,000,000	4,848,610,000	
第340回利付国債(10年)	6,320,000,000	6,459,924,800	
第341回利付国債(10年)	3,440,000,000	3,505,876,000	
第342回利付国債(10年)	5,220,000,000	5,276,428,200	
第343回利付国債(10年)	4,820,000,000	4,874,996,200	
第344回利付国債(10年)	6,640,000,000	6,719,746,400	

第345回利付国債(10年)	3,340,000,000	3,382,084,000	
第346回利付国債(10年)	6,350,000,000	6,433,756,500	
第347回利付国債(10年)	3,880,000,000	3,933,505,200	
第348回利付国債(10年)	5,090,000,000	5,163,245,100	
第349回利付国債(10年)	4,130,000,000	4,191,908,700	
第350回利付国債(10年)	7,830,000,000	7,949,329,200	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,610,000,000	4,682,976,300	
第352回利付国債(10年)	4,610,000,000	4,685,696,200	
第353回利付国債(10年)	4,430,000,000	4,503,670,900	
第354回利付国債(10年)	5,090,000,000	5,175,562,900	
第355回利付国債(10年)	4,820,000,000	4,899,867,400	
第356回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,327,606,200	
第357回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,843,428,000	
第358回利付国債(10年)	3,790,000,000	3,847,191,100	
第359回利付国債(10年)	4,030,000,000	4,087,185,700	
第360回利付国債(10年)	5,740,000,000	5,813,185,000	
第361回利付国債(10年)	4,920,000,000	4,977,465,600	
第362回利付国債(10年)	4,850,000,000	4,901,070,500	
第363回利付国債(10年)	1,840,000,000	1,857,148,800	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	135,753,200	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	193,859,200	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	144,880,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	139,874,900	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	60,743,000	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	435,155,000	
第7回利付国債(30年)	180,000,000	223,500,600	
第8回利付国債(30年)	350,000,000	418,047,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	276,021,600	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	178,814,400	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	309,337,600	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	235,624,700	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	492,536,000	
第14回利付国債(30年)	800,000,000	1,027,824,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	442,482,800	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	261,114,000	
第17回利付国債(30年)	950,000,000	1,232,473,000	
第18回利付国債(30年)	345,000,000	444,256,500	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	684,330,700	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	634,622,400	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	648,940,000	
第22回利付国債(30年)	420,000,000	558,759,600	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	574,045,700	

第24回利付国債(30年)	380,000,000	508,656,600
第25回利付国債(30年)	350,000,000	459,294,500
第26回利付国債(30年)	1,140,000,000	1,516,473,600
第27回利付国債(30年)	1,920,000,000	2,597,702,400
第28回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,910,849,400
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,254,333,000
第30回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,368,826,400
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,458,358,000
第32回利付国債(30年)	1,560,000,000	2,105,173,200
第33回利付国債(30年)	1,820,000,000	2,363,342,800
第34回利付国債(30年)	1,795,000,000	2,405,479,500
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	3,006,238,000
第36回利付国債(30年)	2,160,000,000	2,833,077,600
第37回利付国債(30年)	2,160,000,000	2,800,677,600
第38回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,920,840,000
第39回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,955,550,000
第40回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,977,344,600
第41回利付国債(30年)	990,000,000	1,252,488,600
第42回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,899,780,000
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,762,394,900
第44回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,548,521,600
第45回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,717,562,000
第46回利付国債(30年)	1,750,000,000	2,148,457,500
第47回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,852,205,200
第48回利付国債(30年)	1,860,000,000	2,246,284,800
第49回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,739,937,600
第50回利付国債(30年)	1,790,000,000	1,913,796,400
第51回利付国債(30年)	1,760,000,000	1,674,851,200
第52回利付国債(30年)	1,910,000,000	1,903,620,600
第53回利付国債(30年)	980,000,000	998,659,200
第54回利付国債(30年)	2,110,000,000	2,248,416,000
第55回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,640,038,400
第56回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,785,957,600
第57回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,710,415,700
第58回利付国債(30年)	2,600,000,000	2,760,290,000
第59回利付国債(30年)	950,000,000	983,307,000
第60回利付国債(30年)	2,540,000,000	2,752,750,400
第61回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,682,078,500
第62回利付国債(30年)	20,000,000	19,573,000
第63回利付国債(30年)	1,160,000,000	1,103,357,200
第64回利付国債(30年)	2,510,000,000	2,380,785,200
第65回利付国債(30年)	860,000,000	813,431,000
第66回利付国債(30年)	1,030,000,000	972,629,000

第67回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,401,384,900	
第68回利付国債(30年)	1,640,000,000	1,627,896,800	
第69回利付国債(30年)	930,000,000	946,107,600	
第70回利付国債(30年)	1,770,000,000	1,798,638,600	
第71回利付国債(30年)	850,000,000	861,687,500	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	306,582,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	204,874,000	
第60回利付国債(20年)	350,000,000	357,136,500	
第61回利付国債(20年)	240,000,000	244,310,400	
第62回利付国債(20年)	320,000,000	325,472,000	
第63回利付国債(20年)	200,000,000	207,078,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	333,558,400	
第65回利付国債(20年)	220,000,000	230,419,200	
第66回利付国債(20年)	330,000,000	344,856,600	
第67回利付国債(20年)	130,000,000	136,810,700	
第68回利付国債(20年)	190,000,000	201,426,600	
第69回利付国債(20年)	390,000,000	412,448,400	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	428,748,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	213,240,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	673,501,500	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	385,678,800	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	214,934,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	140,429,900	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	289,723,500	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	312,225,600	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	183,299,100	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	292,161,600	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	238,902,400	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	424,128,900	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	654,966,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	318,202,500	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	513,663,000	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	319,820,700	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	567,135,300	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	2,026,596,900	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	469,547,400	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	389,592,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	705,014,100	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	505,881,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	985,239,200	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	459,019,600	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	686,353,700	

第95回利付国債(20年)	610,000,000	696,992,100
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,798,099,200
第97回利付国債(20年)	400,000,000	457,084,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	500,095,200
第99回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,473,489,600
第100回利付国債(20年)	480,000,000	553,953,600
第101回利付国債(20年)	715,000,000	834,640,950
第102回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,478,988,000
第103回利付国債(20年)	400,000,000	466,768,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	184,504,000
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,367,454,800
第106回利付国債(20年)	380,000,000	443,080,000
第107回利付国債(20年)	260,000,000	302,660,800
第108回利付国債(20年)	660,000,000	758,531,400
第109回利付国債(20年)	520,000,000	600,038,400
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,286,120,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,146,394,500
第112回利付国債(20年)	790,000,000	927,428,400
第113回利付国債(20年)	1,520,000,000	1,791,548,000
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,756,902,600
第115回利付国債(20年)	700,000,000	834,120,000
第116回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,782,457,200
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,282,672,800
第118回利付国債(20年)	660,000,000	780,615,000
第119回利付国債(20年)	530,000,000	617,455,300
第120回利付国債(20年)	1,570,000,000	1,801,198,200
第121回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,765,080,000
第122回利付国債(20年)	940,000,000	1,097,562,800
第123回利付国債(20年)	1,870,000,000	2,241,456,800
第124回利付国債(20年)	610,000,000	725,466,900
第125回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,205,385,000
第126回利付国債(20年)	730,000,000	870,590,700
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,206,670,200
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,150,497,600
第129回利付国債(20年)	890,000,000	1,046,871,400
第130回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,515,773,150
第131回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,169,530,000
第132回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,360,111,600
第133回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,454,856,300
第134回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,340,078,300
第135回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,210,641,400
第136回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,689,032,500
第137回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,284,314,300

第138回利付国債（20年）	620,000,000	717,172,600	
第139回利付国債（20年）	730,000,000	852,275,000	
第140回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,692,908,000	
第141回利付国債（20年）	1,540,000,000	1,823,082,800	
第142回利付国債（20年）	1,020,000,000	1,218,971,400	
第143回利付国債（20年）	1,800,000,000	2,114,928,000	
第144回利付国債（20年）	1,420,000,000	1,652,155,800	
第145回利付国債（20年）	2,895,000,000	3,444,355,200	
第146回利付国債（20年）	2,890,000,000	3,445,862,600	
第147回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,944,748,700	
第148回利付国債（20年）	2,230,000,000	2,614,385,100	
第149回利付国債（20年）	2,930,000,000	3,440,669,700	
第150回利付国債（20年）	3,260,000,000	3,792,325,400	
第151回利付国債（20年）	2,025,000,000	2,305,786,500	
第152回利付国債（20年）	3,290,000,000	3,749,481,400	
第153回利付国債（20年）	2,530,000,000	2,920,100,700	
第154回利付国債（20年）	2,600,000,000	2,968,160,000	
第155回利付国債（20年）	2,860,000,000	3,187,527,200	
第156回利付国債（20年）	2,600,000,000	2,675,504,000	
第157回利付国債（20年）	3,080,000,000	3,077,782,400	
第158回利付国債（20年）	2,730,000,000	2,845,697,400	
第159回利付国債（20年）	2,930,000,000	3,095,046,900	
第160回利付国債（20年）	2,460,000,000	2,633,823,600	
第161回利付国債（20年）	2,190,000,000	2,310,187,200	
第162回利付国債（20年）	620,000,000	653,535,800	
第163回利付国債（20年）	2,610,000,000	2,748,956,400	
第164回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,720,556,800	
第165回利付国債（20年）	1,790,000,000	1,853,258,600	
第166回利付国債（20年）	900,000,000	960,813,000	
第167回利付国債（20年）	2,690,000,000	2,778,581,700	
第168回利付国債（20年）	2,430,000,000	2,464,384,500	
第169回利付国債（20年）	1,690,000,000	1,681,448,600	
第170回利付国債（20年）	2,360,000,000	2,343,904,800	
第171回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,278,880,200	
第172回利付国債（20年）	2,760,000,000	2,781,638,400	
第173回利付国債（20年）	3,110,000,000	3,129,157,600	
第174回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,491,036,000	
第175回利付国債（20年）	1,560,000,000	1,593,696,000	
第176回利付国債（20年）	2,810,000,000	2,866,200,000	
第177回利付国債（20年）	860,000,000	860,782,600	
国債証券合計	512,070,000,000	548,750,299,000	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	105,815,000

第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,134,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	133,544,000	
第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	132,080,000	
第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	128,250,000	
第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	127,603,000	
第16回東京都公募公債(20年)	300,000,000	343,086,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,946,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	116,314,000	
第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	100,604,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,748,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	234,356,000	
第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	200,042,000	
第716回東京都公募公債	100,000,000	101,021,000	
第717回東京都公募公債	100,000,000	100,987,000	
第720回東京都公募公債	100,000,000	101,586,000	
第726回東京都公募公債	200,000,000	203,384,000	
第728回東京都公募公債	100,000,000	101,506,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	101,581,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	101,030,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,901,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	302,553,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	200,414,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,205,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,948,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	100,351,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,128,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	202,056,000	
第29回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	101,473,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	273,038,000	
第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,076,000	
第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	234,506,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,010,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,125,000	
第78回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	200,004,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	202,976,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,823,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,946,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,901,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	200,330,000	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	234,510,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	234,442,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	117,259,000	

第371回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,959,000	
第375回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,670,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,578,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,661,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	153,361,640	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,086,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,062,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,583,440	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,930,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	500,000,000	505,065,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,092,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	117,182,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	116,993,000	
平成25年度第7回京都府公募公債	100,000,000	101,656,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,099,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	100,604,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	104,713,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	141,215,145	
第1回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	103,122,000	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	114,157,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	102,026,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	400,000,000	436,192,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	107,874,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,010,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	472,088,000	
平成25年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	101,625,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	101,599,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	103,530,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	302,394,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	121,861,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	104,734,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	117,267,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	115,989,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	101,068,000	
平成26年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,867,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,960,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	101,076,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	101,091,000	
平成29年度第14回静岡県公募公債(5年)	100,000,000	100,055,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	313,995,900	

平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	117,484,000	
平成24年度第18回愛知県公募公債（10年）	150,000,000	151,822,500	
平成24年度第19回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,016,000	
平成25年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,960,000	
平成26年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,778,000	
平成26年度第5回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	203,632,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,664,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,318,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	202,310,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	313,014,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,000,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	103,593,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,590,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,800,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	200,888,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	116,211,000	
平成21年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	233,604,000	
平成24年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,027,000	
平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	101,510,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	127,745,870	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,862,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	113,934,000	
第5回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	115,178,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	231,292,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	108,450,000	
第7回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	235,148,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	200,000,000	202,594,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	234,506,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	201,220,000	
平成24年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,217,000	
平成25年度第11回埼玉県公募公債	100,000,000	101,689,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,017,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,357,000	

平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,289,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,961,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,591,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	100,509,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	114,107,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	114,654,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	107,084,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	118,602,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	107,773,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	132,552,000	
平成25年度第9回福岡県公募公債	100,000,000	101,700,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	113,429,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,995,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	103,593,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	104,637,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	302,637,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	100,678,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	100,344,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	231,292,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	116,960,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	117,267,000	
平成24年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,021,000	
平成25年度第5回千葉県公募公債	100,000,000	101,681,000	
平成25年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	101,632,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	101,489,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,042,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	100,356,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	121,074,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	300,633,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,814,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	303,306,000	
平成30年度第3回茨城県公募公債	100,000,000	100,050,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	101,050,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,007,000	
第117回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,916,000	
第119回共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,816,000	
第121回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,949,000	

第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,284,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,473,000	
第128回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,483,000	
第130回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,674,000	
第131回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,645,000	
第132回共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,097,000	
第134回共同発行市場公募地方債	112,000,000	114,069,760	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,864,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,776,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,688,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,634,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,946,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,114,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	128,099,862	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,094,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,436,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,350,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,632,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,460,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	401,172,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,184,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,895,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,267,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,866,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	195,599,867	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,110,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,898,000	
平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	200,000,000	201,884,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,155,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	235,526,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	302,853,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	105,155,000	
平成25年度第8回大阪市公募公債	100,000,000	101,867,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	201,546,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	130,539,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	135,532,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	114,800,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	126,646,000	
第481回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,987,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	101,117,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	302,502,000	
平成24年度第4回京都市公募公債	100,000,000	100,932,000	

平成24年度第5回京都市公募公債	100,000,000	101,232,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	201,792,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	134,695,200	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	231,644,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	118,302,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	117,576,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	99,495,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	108,300,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	349,854,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,867,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	101,267,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	101,062,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	203,480,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	229,880,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	302,496,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,725,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	108,095,000	
平成24年度第10回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,061,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	101,418,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	116,215,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,771,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	100,406,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,476,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,050,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	100,325,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	116,769,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	116,191,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	203,406,000	
平成30年度第5回福岡市公募公債（5年）	200,000,000	200,098,000	
平成30年度第9回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	101,749,000	
平成30年度第10回福岡市公募公債（5年）	200,000,000	200,070,000	
平成30年度第11回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	100,039,000	
平成25年度第3回広島市公募公債	150,000,000	152,505,000	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,511,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,841,050	

	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	172,153,900	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	552,794,000	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	200,000,000	200,124,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	200,422,000	
	平成25年度第4回福井県公募公債	100,000,000	101,863,000	
	平成24年度第1回徳島県公募公債	100,000,000	101,074,000	
	平成24年度第2回岡山県公募公債（10年）	150,000,000	151,626,000	
	平成24年度第1回岡山市公募公債（10年）	200,000,000	202,434,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	202,238,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	114,178,000	
	地方債証券合計	34,129,430,000	35,934,027,134	
特殊債券	第2回政府保証新関西国際空港債券	102,000,000	103,694,220	
	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	410,000,000	414,387,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	300,000,000	312,159,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,398,000	
	第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	300,000,000	299,955,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	95,667,000	
	第14回道路債券	100,000,000	102,536,000	
	第17回道路債券	100,000,000	102,041,000	
	第21回道路債券	100,000,000	129,707,000	
	第27回道路債券	400,000,000	424,764,000	
	第28回道路債券	200,000,000	263,140,000	
	第33回道路債券	200,000,000	267,126,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,138,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	152,379,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,939,000	
	第42回道路債券	100,000,000	107,875,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,791,000	
	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	144,344,000	
	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	233,474,000	
	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	235,836,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,487,000	
	第102回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,072,000	

第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	900,000,000	910,026,000	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,625,000	
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	132,104,000	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,620,000	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,496,000	
第118回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,749,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,192,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,069,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,521,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,771,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	225,822,000	
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,048,000	
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	117,118,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,231,000	
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	303,798,000	
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	202,146,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	624,588,000	
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	304,832,760	
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	634,920,560	
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	203,336,000	
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	150,484,920	
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	101,525,000	
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	269,821,554	
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	203,244,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,987,000	
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	429,667,740	
	100,000,000	101,667,000	

第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	231,928,000	
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	103,824,780	
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	101,827,000	
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	101,757,000	
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	230,552,000	
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	101,708,000	
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	101,546,000	
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	303,258,000	
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	112,347,000	
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	226,316,000	
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	202,800,000	
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	100,633,000	
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	95,771,000	
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	106,971,110	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	316,000,000	317,267,160	
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	206,170,550	
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	100,757,000	
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	201,478,000	
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	100,873,000	
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	121,447,200	
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	201,828,000	
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	313,572,000	
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	217,060,200	
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	99,917,000	
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	99,762,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	379,065,000	

第3回公営企業債券(20年)	210,000,000	213,397,800	
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	100,000,000	108,155,000	
第5回公営企業債券(30年)	300,000,000	395,403,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,635,000	
第7回公営企業債券(30年)	200,000,000	264,904,000	
第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	42,305,600	
第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	130,448,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	234,512,000	
第10回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	229,946,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	200,000,000	196,058,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	234,932,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	116,887,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,009,000	
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,410,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,246,000	
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,241,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,146,000	
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,927,000	
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,077,000	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,686,000	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	105,000,000	106,564,500	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,266,000	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,643,000	
第58回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,870,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,923,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,613,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,611,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,974,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,570,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,613,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,068,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,152,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,398,000	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,568,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	252,842,340	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,556,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,885,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,866,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	111,318,900	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,888,000	

第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	158,166,840	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,421,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,606,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,879,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,215,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,324,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,729,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,017,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	107,635,000	
第22回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	199,952,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	116,979,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	119,793,000	
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	200,000,000	202,514,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	126,085,680	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,886,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	211,022,700	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	189,494,580	
第87回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,902,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	213,198,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	170,726,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	93,493,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	200,352,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	107,294,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	102,483,000	
第346回東京交通債券	20,000,000	20,408,600	
第59回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	99,988,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	100,832,000	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,253,000	11,472,320	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,650,000	11,913,872	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	11,922,000	12,232,091	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	160,887,000	160,985,141	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	114,772,000	114,917,760	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,681,000	11,955,853	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,651,000	13,026,228	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	208,062,000	207,801,922	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,101,000	10,123,525	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	21,088,000	21,319,335	

第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,530,000	12,894,497	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	227,454,000	226,969,522	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	81,134,000	81,192,416	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,140,000	11,341,968	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,031,000	13,459,198	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	264,819,000	265,073,226	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	11,199,000	11,403,045	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	182,664,000	182,954,435	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,148,000	13,595,426	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,998,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,282,000	18,315,636	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,551,000	18,670,929	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,374,000	20,712,162	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,287,000	22,671,719	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,541,000	25,239,012	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,067,000	25,769,499	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,304,000	54,836,793	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,439,000	11,635,293	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,289,000	24,616,240	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,563,000	11,788,478	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,281,000	11,525,008	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,156,000	25,531,925	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,571,000	10,689,183	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,990,000	25,415,965	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,802,000	24,076,175	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,499,000	12,947,714	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,754,000	51,199,500	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,191,000	27,583,051	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,215,000	12,588,412	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,687,000	38,772,655	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,672,000	36,576,186	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,786,000	36,723,928	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,238,000	80,352,564	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,770,000	87,754,938	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,846,000	44,844,337	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,182,000	45,556,578	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,363,000	45,804,336	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,730,000	39,678,754	

第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,374,000	39,033,779
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,984,000	45,435,807
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	178,479,000
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,162,000	119,222,801
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,744,000	160,582,533
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,759,000	45,646,763
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,071,000	47,050,518
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,919,000	47,812,240
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,464,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,734,000	151,722,210
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,761,000	51,607,133
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,116,000	107,318,608
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,380,000	60,380,098
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,922,000	63,883,069
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,591,000	63,845,846
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,758,000	198,521,850
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	128,198,000	133,288,742
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,140,000	64,476,464
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,311,000	69,908,531
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,385,000	73,998,498
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,778,000	79,604,381
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,552,000	79,212,622
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,841,000	79,861,202
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,252,000	80,625,437
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,021,000	81,290,133
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,487,000	82,765,531
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,189,000	83,575,528
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,086,000	83,252,442
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,314,000	83,480,389
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,822,000	84,045,280
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,444,000	169,567,189
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,959,000	84,127,062
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,846,000	171,645,466

第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,251,000	85,450,734	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,518,000	170,663,234	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,173,000	86,401,194	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,556,000	173,648,983	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,596,000	174,686,137	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	130,896,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,420,000	88,986,566	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,162,000	88,906,111	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,210,000	88,252,159	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,928,000	180,339,741	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,497,000	90,124,373	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,313,000	90,068,587	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,436,000	181,727,921	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,186,000	91,197,854	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	275,526,000	274,220,006	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,658,000	183,756,868	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,653,000	94,543,640	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,475,000	95,078,695	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,222,000	195,486,561	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,355,000	98,379,174	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,278,000	197,308,891	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,892,000	197,590,383	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,108,000	99,205,828	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,654,000	199,672,638	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,094,000	200,942,591	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,436,000	100,775,402	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,617,000	

	第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,000,000	
	第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,009,000	
	第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,559,000	
	第60回日本学生支援債券	200,000,000	199,982,000	
	第62回日本学生支援債券	100,000,000	99,986,000	
	第64回日本学生支援債券	300,000,000	300,006,000	
	第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	107,736,000	
	い第823号商工債	200,000,000	200,610,000	
	い第829号商工債	200,000,000	200,516,000	
	い第832号商工債	200,000,000	200,062,000	
	い第833号商工債	100,000,000	100,000,000	
	い第843号商工債	200,000,000	200,480,000	
	第337回信金中金債（5年）	100,000,000	100,122,000	
	第338回信金中金債（5年）	100,000,000	100,122,000	
	第339回信金中金債（5年）	200,000,000	200,258,000	
	第342回信金中金債（5年）	100,000,000	100,149,000	
	第350回信金中金債（5年）	100,000,000	100,121,000	
	第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,870,000	
	第376回信金中金債（5年）	100,000,000	100,068,000	
	第236号商工債（3年）	300,000,000	299,967,000	
	第254号商工債（3年）	300,000,000	300,078,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	101,986,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	118,026,000	
	第48回東日本高速道路株式会社社債	600,000,000	600,558,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,369,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,926,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	504,185,000	
	第83回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,033,000	
	第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,386,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,165,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	201,164,000	
	第141回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,976,000	
	特殊債券合計	38,351,913,000	39,986,307,467	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	100,333,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	299,733,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,251,000	
	第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,594,000	

第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,354,000	
第15回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,244,000	
第17回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,981,000	
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,179,000	
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	400,292,000	
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	100,000,000	99,908,000	
第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,968,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,746,000	
第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	199,586,000	
第7回住友林業株式会社無担保社債	100,000,000	100,059,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	300,711,000	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,844,000	
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	100,437,000	
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	199,770,000	
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	100,486,000	
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	199,826,000	
第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,851,000	
第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,950,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,255,000	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,921,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,156,000	
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	100,633,000	
第2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	101,807,000	
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	99,876,000	
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	101,355,000	
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	200,812,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	100,114,000	
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	101,765,000	
第9回イビデン株式会社無担保社債	100,000,000	99,819,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	101,218,000	
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	101,294,000	

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	200,824,000	
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	200,864,000	
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	100,237,000	
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	101,232,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	101,047,000	
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	400,000,000	399,824,000	
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	200,000,000	199,766,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,401,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	203,768,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,268,000	
第42回DIC株式会社無担保社債	100,000,000	100,087,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	99,366,000	
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	199,960,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,556,000	
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,983,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,788,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,554,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,485,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,286,000	
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,187,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,972,000	
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,144,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	100,053,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	108,597,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,461,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	100,258,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,325,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,927,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,455,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,380,000	
第20回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,008,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,364,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,164,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,942,000	
第19回株式会社デンソー無担保社債	300,000,000	299,700,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,672,000	

第35回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,623,000	
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,192,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,219,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	201,874,000	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	200,000,000	199,344,000	
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	199,960,000	
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	100,143,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,201,000	
第21回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,754,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,521,000	
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,933,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,962,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	118,465,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	201,302,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,794,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,468,000	
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	100,135,000	
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	117,548,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	111,893,000	
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,041,000	
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	101,306,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,426,000	
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	300,000,000	303,978,000	
第3回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,364,000	
第4回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,386,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,814,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,894,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	100,006,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,287,000	
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,790,000	
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,383,000	
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,321,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,374,000	
第37回リコーリース株式会社無担保社債	300,000,000	299,847,000	

第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,021,000	
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	200,006,000	
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	100,014,000	
第30回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,371,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,117,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,203,000	
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,334,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,215,000	
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	199,944,000	
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	200,514,000	
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,182,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	202,398,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,748,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,870,000	
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	100,623,000	
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	200,280,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,630,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	201,334,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,277,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,559,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,132,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,137,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,311,000	
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	101,864,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,258,000	
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,795,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,062,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,600,000	
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	199,702,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,497,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,372,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,541,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,024,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,468,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,010,000	
	200,000,000	233,122,000	

第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債			
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,911,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,555,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,824,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,331,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,616,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,358,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,057,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	115,154,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,227,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,480,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	501,115,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,110,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	131,574,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	125,299,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,702,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,774,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	93,227,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	92,224,000	
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	195,756,000	
第6回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,976,000	
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	100,141,000	
第20回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,622,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,150,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	400,560,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,530,000	
第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,821,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,271,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,523,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,398,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,417,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,630,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	203,872,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,473,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,114,000	

第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,317,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,825,000	
第385回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,477,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,733,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,239,000	
第402回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,587,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	202,524,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,170,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,607,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,479,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	202,372,000	
第471回東北電力株式会社社債	126,000,000	129,272,220	
第481回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,771,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,360,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,119,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	203,254,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,278,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,034,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,775,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	101,372,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,190,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	203,206,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,264,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,730,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	202,350,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,628,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,048,000	
第326回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,938,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,684,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,558,000	
第13回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	107,422,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,148,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,075,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,645,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,063,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	206,888,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	400,000,000	405,476,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,166,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	305,157,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,532,000	

第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,598,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,577,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	201,880,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	201,642,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	101,099,000	
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,500,000	
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,604,000	
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	203,442,000	
社債券合計	29,226,000,000	29,662,983,220	
合計		654,333,616,821	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,266,749,427
コール・ローン	365,876,715
株式	498,305,440,987
投資信託受益証券	303,360,850
投資証券	11,639,038,113
派生商品評価勘定	243,588,589
未収入金	2,331,311
未収配当金	691,753,978
差入委託証拠金	3,676,731,853
流動資産合計	522,494,871,823
資産合計	522,494,871,823
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,389,022
前受金	238,206,119

	2021年 8月20日現在
項目	金額（円）
未払金	353,967,499
未払解約金	260,653,947
未払利息	656
流動負債合計	858,217,243
負債合計	858,217,243
純資産の部	
元本等	
元本	133,932,817,817
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	387,703,836,763
元本等合計	521,636,654,580
純資産合計	521,636,654,580
負債純資産合計	522,494,871,823

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 8月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p>

	2021年 8月20日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	133,932,817,817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 3.8948円 (1万口当たり純資産額) (38,948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

	2021年 8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。

	2021年 8月20日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2.金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	2021年 8月20日現在

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月21日
期首元本額	148,003,539,860円
期中追加設定元本額	19,162,932,402円
期中一部解約元本額	33,233,654,445円
期末元本額	133,932,817,817円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,981,880,686円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,569,870円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	28,283,719,835円
世界経済インデックスファンド	8,741,397,272円
外国株式インデックス・オープン	831,456,139円
D C マイセレクション 2 5	847,288,012円
D C マイセレクション 5 0	4,002,547,745円
D C マイセレクション 7 5	4,492,907,579円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,272,575,204円
D C マイセレクション S 2 5	411,246,830円
D C マイセレクション S 5 0	1,878,575,263円
D C マイセレクション S 7 5	1,513,224,413円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	68,833,172円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	186,585,184円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	131,248,354円
D C 世界経済インデックスファンド	9,894,746,779円

区分	2021年 8月20日現在
外国株式インデックス・オープン(S M A 専用)	1,865,590,173円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	5,297,557円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	5,085,097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)	30,678,825円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	24,100,476円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	85,061,777円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	14,588,632円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	44,379,526円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	374,399,408円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	209,159,289円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,513,633,909円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	386,216,976円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	42,014,703円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	205,533,587円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	70,445,707円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,184,199,192円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,327,938,351円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,128,039,376円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,206,156,730円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,484,802,222円
分散投資コア戦略ファンドA	1,517,087,653円
分散投資コア戦略ファンドS	8,477,877,522円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,237,713,628円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,123,067,084円
コア投資戦略ファンド(切替型)	984,435,808円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	632,563,373円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	30,787,428円
S M T インデックスバランス・オープン	171,800,104円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	673,332,011円
外国株式S M T B セレクション(S M A 専用)	24,111,612,409円
S M T 世界経済インデックス・オープン	163,510,676円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	567,506,160円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	107,255,703円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,515,690円
i - S M T グローバル株式インデックス(ノーロード)	116,889,214円
グローバル経済コア	668,092,981円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A 対応型)	11,923,304円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	4,761,997円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	664,326,699円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	78,275,691円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	12,996,145円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	9,688,659円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	4,445,079円

区分	2021年 8月20日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	4,114,034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）	560,185,273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）	879,086,833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）	1,436,272,188円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	894,404,047円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	140,237,021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）	4,684,544円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	34,174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）	21,644円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	277,587,747円
SMTAMバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	260,107,582円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	279,785,392円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	270,292,284円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	268,409,933円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	265,829,351円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	266,176,902円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	20,738,153,346
投資信託受益証券	18,976,014
投資証券	834,091,970
合計	21,591,221,330

(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

（2021年 8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	株価指数先物取引 買建	11,475,197,335	-	11,713,403,454	238,206,119
	合計	11,475,197,335	-	11,713,403,454	238,206,119

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2021年 8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		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	531,643,480	-	531,636,928	6,552
	アメリカドル	167,017,600	-	167,027,176	9,576
	ユーロ	364,625,880	-	364,609,752	16,128
合計		531,643,480	-	531,636,928	6,552

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	57,980	20.19	1,170,616.20	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	83.04	1,580,583.36	
	CHEVRON CORP	162,537	94.29	15,325,613.73	
	CONOCOPHILLIPS	113,805	52.44	5,967,934.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	57,000	25.34	1,444,380.00	
	EOG RESOURCES INC	48,739	64.26	3,131,968.14	
	EXXON MOBIL	357,409	52.73	18,846,176.57	
	HALLIBURTON CO	77,539	18.15	1,407,332.85	
	HESS CORP	22,781	63.59	1,448,643.79	
	KINDER MORGAN INC	169,739	15.89	2,697,152.71	
	MARATHON PETROLEUM CORP	54,237	54.23	2,941,272.51	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	22.09	1,747,451.54	
	ONEOK INC	37,709	49.27	1,857,922.43	

PHILLIPS 66	38,113	66.27	2,525,748.51
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,954	140.47	2,521,998.38
SCHLUMBERGER	116,716	26.44	3,085,971.04
VALERO ENERGY CORP	34,683	60.24	2,089,303.92
WILLIAMS COS	104,984	23.89	2,508,067.76
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	18,561	271.39	5,037,269.79
ALBEMARLE CORP	10,180	213.35	2,171,903.00
AMCOR PLC	132,975	12.40	1,648,890.00
AVERY DENNISON CORP	7,457	215.47	1,606,759.79
BALL CORP	27,925	92.50	2,583,062.50
CELANESE CORP-SERIES A	9,842	152.36	1,499,527.12
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	43.34	826,537.14
CORTEVA INC	64,900	42.55	2,761,495.00
CROWN HOLDINGS INC	11,212	106.81	1,197,553.72
DOW INC	63,659	60.55	3,854,552.45
DUPONT DE NEMOURS INC	46,139	72.92	3,364,455.88
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,075	109.74	1,215,370.50
ECOLAB INC	22,189	220.50	4,892,674.50
FMC CORP	10,507	88.55	930,394.85
FREEMPORT-MCMORAN INC	125,342	32.42	4,063,587.64
INT'L PAPER CO	30,800	58.16	1,791,328.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,184	149.40	3,164,889.60
LINDE PLC	44,125	311.17	13,730,376.25
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	97.27	2,205,402.71
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	372.93	1,984,360.53
MOSAIC CO/THE	31,911	29.57	943,608.27
NEWMONT CORPORATION	68,576	56.52	3,875,915.52
NUCOR CORP	25,565	117.43	3,002,097.95
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	145.09	1,115,306.83
PPG INDUSTRIES INC	20,538	161.14	3,309,493.32
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	83.22	870,148.32
SEALED AIR CORP	14,689	59.09	867,973.01
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,917	302.64	6,632,960.88
STEEL DYNAMICS INC	18,273	67.16	1,227,214.68
VULCAN MATERIALS CO	11,347	183.31	2,080,018.57
WESTROCK CO	21,356	48.79	1,041,959.24
3 M COMPANY	48,764	195.36	9,526,535.04
ALLEGION PLC	7,601	140.22	1,065,812.22
AMETEK INC	19,666	134.37	2,642,520.42
BOEING CO	46,662	212.16	9,899,809.92
CARRIER GLOBAL CORP	70,603	55.25	3,900,815.75
CATERPILLAR	45,919	204.45	9,388,139.55

CUMMINS INC	12,914	231.50	2,989,591.00
DEERE&CO	25,063	358.98	8,997,115.74
DOVER CORP	12,202	172.42	2,103,868.84
EATON CORP	33,384	166.94	5,573,124.96
EMERSON ELECTRIC CO	51,393	101.23	5,202,513.39
FASTENAL CO	48,796	55.06	2,686,707.76
FORTIVE CORP	25,722	73.46	1,889,538.12
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	97.39	1,247,565.90
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	391.85	2,041,930.35
GENERAL DYNAMICS CORP	20,350	195.49	3,978,221.50
GENERAL ELECTRIC CO	92,290	99.42	9,175,471.80
GRAINGER (WW) INC	3,846	429.66	1,652,472.36
HEICO CORP	3,640	127.39	463,699.60
HEICO CORP-CLASS A	6,449	116.40	750,663.60
HONEYWELL INTL INC	58,647	227.73	13,355,681.31
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	31.75	1,003,109.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	200.16	704,963.52
IDEX CORP	5,916	220.67	1,305,483.72
ILLINOIS TOOL WORKS	26,587	230.20	6,120,327.40
INGERSOLL-RAND INC	31,562	49.74	1,569,893.88
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	17,700	55.41	980,757.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	60,279	73.03	4,402,175.37
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,086	230.12	4,161,950.32
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	330.20	1,011,072.40
LOCKHEED MARTIN CORP	21,206	354.03	7,507,560.18
MASCO CORP	23,467	59.99	1,407,785.33
NORDSON CORP	4,880	226.14	1,103,563.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,571	361.09	4,900,352.39
OTIS WORLDWIDE CORP	35,040	90.20	3,160,608.00
OWENS CORNING	8,642	91.59	791,520.78
PACCAR INC	30,155	80.37	2,423,557.35
PARKER HANNIFIN CORP	11,234	287.33	3,227,865.22
PENTAIR PLC	14,533	78.29	1,137,788.57
PLUG POWER INC	41,884	23.76	995,163.84
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	128,033	83.35	10,671,550.55
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,938	314.40	3,124,507.20
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,784	477.09	4,190,758.56
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	57.56	795,939.68
SMITH (A.O.) CORP	12,146	70.33	854,228.18
SNAP-ON INC	4,900	216.38	1,060,262.00
STANLEY BLACK&DECKER	13,718	189.68	2,602,030.24
SUNRUN INC	13,917	41.00	570,597.00

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	446.03	1,739,070.97
TEXTRON	18,893	69.84	1,319,487.12
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,642	193.95	4,003,515.90
TRANSDIGM GROUP INC	4,425	589.47	2,608,404.75
UNITED RENTALS INC	6,103	331.44	2,022,778.32
WABTEC CORP	15,024	85.49	1,284,401.76
XYLEM INC	15,209	130.25	1,980,972.25
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	81.31	924,006.84
CINTAS CORP	8,043	391.38	3,147,869.34
CLARIVATE PLC	27,357	22.99	628,937.43
COPART INC	18,067	137.59	2,485,838.53
COSTAR GROUP INC	34,030	82.16	2,795,904.80
EQUIFAX INC	10,409	258.78	2,693,641.02
IHS MARKIT LTD	32,602	117.19	3,820,628.38
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,661	131.93	1,406,505.73
LEIDOS HOLDINGS	11,220	96.67	1,084,637.40
REPUBLIC SERVICES INC	18,483	121.12	2,238,660.96
ROBERT HALF INTL INC	9,566	101.63	972,192.58
ROLLINS INC	17,468	38.77	677,234.36
TRANSUNION	15,741	117.40	1,847,993.40
VERISK ANALYTICS INC	13,390	194.68	2,606,765.20
WASTE CONNECTIONS INC	22,454	126.57	2,842,002.78
WASTE MANAGEMENT INC	36,263	151.62	5,498,196.06
AMERCO	1,000	640.00	640,000.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	87.77	991,098.84
CSX CORP	192,089	33.59	6,452,269.51
DELTA AIR LINES INC	14,609	37.93	554,119.37
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	122.13	1,743,039.36
FEDEX CORP	21,597	267.56	5,778,493.32
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	171.53	1,209,629.56
KANSAS CITY SOUTHERN	7,965	291.07	2,318,372.55
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	48.77	521,839.00
LYFT INC-A	21,288	46.79	996,065.52
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,133	262.20	5,541,072.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	279.51	2,236,918.53
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	47.46	642,276.18
UBER TECHNOLOGIES INC	103,109	39.86	4,109,924.74
UNION PACIFIC CORP	56,461	223.77	12,634,277.97
UNITED PARCEL SERVICE B	60,637	194.06	11,767,216.22
APTIV PLC	23,540	152.92	3,599,736.80
AUTOLIV INC	6,776	91.54	620,275.04
BORGWARNER INC	19,781	42.52	841,088.12

FORD MOTOR COMPANY	334,463	12.67	4,237,646.21
GENERAL MOTORS CO	108,886	49.08	5,344,124.88
LEAR CORP	5,287	154.68	817,793.16
TESLA INC	64,902	673.47	43,709,549.94
DR HORTON INC	29,632	93.24	2,762,887.68
GARMIN LTD	12,854	166.80	2,144,047.20
HASBRO INC	10,572	94.78	1,002,014.16
LENNAR CORP-CL A	22,762	103.78	2,362,240.36
LULULEMON ATHLETICA INC	10,358	396.49	4,106,843.42
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	196.95	996,960.90
NEWELL BRANDS INC	31,461	24.09	757,895.49
NIKE B	107,303	165.59	17,768,303.77
NVR INC	297	5,072.27	1,506,464.19
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	107.80	2,343,140.80
PULTE GROUP INC	21,609	51.74	1,118,049.66
VF CORP	28,638	75.93	2,174,483.34
WHIRLPOOL CORP	5,220	219.35	1,145,007.00
AIRBNB INC-CLASS A	4,665	142.65	665,462.25
ARAMARK	20,955	32.61	683,342.55
BOOKING HOLDINGS INC	3,445	2,075.86	7,151,337.70
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	82.47	1,448,173.20
CARNIVAL CORPORATION	70,520	21.66	1,527,463.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,399	1,870.74	4,487,905.26
DARDEN RESTAURANTS INC	10,712	136.76	1,464,973.12
DOMINO'S PIZZA INC	3,251	518.32	1,685,058.32
DRAFTKINGS INC - CL A	15,674	51.54	807,837.96
EXPEDIA GROUP INC	11,638	138.05	1,606,625.90
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,788	119.23	2,836,243.24
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	36.77	1,079,934.90
MARRIOTT INTL A	23,009	130.26	2,997,152.34
MCDONALD'S CORP	62,893	237.23	14,920,106.39
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	10.91	192,692.42
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,064	37.66	1,245,190.24
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,267	76.50	1,473,925.50
STARBUCKS CORP	99,234	114.32	11,344,430.88
VAIL RESORTS INC	3,574	285.28	1,019,590.72
WYNN RESORTS LTD	9,302	88.68	824,901.36
YUM BRANDS INC	25,844	133.96	3,462,062.24
ACTIVISION BLIZZARD INC	65,003	83.17	5,406,299.51
ALPHABET INC-CL A	25,430	2,713.60	69,006,848.00
ALPHABET INC-CL C	24,928	2,738.27	68,259,594.56
ALTICE USA INC- A	22,505	27.00	607,635.00

CABLE ONE INC	445	2,019.90	898,855.50
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	11,410	785.54	8,963,011.40
COMCAST CORP-CL A	385,983	58.96	22,757,557.68
DISCOVERY INC - A	12,804	27.74	355,182.96
DISCOVERY INC-C	28,190	26.45	745,625.50
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	42.02	845,946.64
ELECTRONIC ARTS INC	24,944	140.60	3,507,126.40
FACEBOOK INC-A	203,410	355.12	72,234,959.20
FOX CORP - CLASS A	27,658	36.18	1,000,666.44
FOX CORP- CLASS B	15,092	33.46	504,978.32
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	127.42	856,389.82
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	36.10	1,221,407.40
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	179.49	462,904.71
LIBERTY BROADBAND-C	13,516	185.26	2,503,974.16
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	47.26	726,811.54
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	47.61	646,734.24
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	47.30	301,963.20
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	79.50	1,105,686.00
MATCH GROUP INC	21,851	133.55	2,918,201.05
NETFLIX INC	37,386	543.71	20,327,142.06
NEWS CORP-CLASS A	33,479	21.87	732,185.73
OMNICOM GROUP	18,031	71.12	1,282,364.72
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	52.60	2,407,344.20
ROKU INC	9,122	343.35	3,132,038.70
SEA LTD-ADR	638	321.12	204,874.56
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.17	614,211.16
SNAP INC - A	78,901	70.86	5,590,924.86
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,738	162.27	1,580,185.26
THE WALT DISNEY CO	153,336	173.25	26,565,462.00
TWITTER INC	66,866	62.05	4,149,035.30
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	39.64	1,925,949.04
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	93.50	513,969.50
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	91.10	1,223,199.70
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	208.37	1,109,361.88
AMAZON.COM	36,205	3,187.75	115,412,488.75
AUTOZONE INC	1,986	1,632.64	3,242,423.04
BATH & BODY WORKS INC	19,806	65.51	1,297,491.06
BEST BUY COMPANY INC	19,870	109.76	2,180,931.20
BURLINGTON STORES INC	5,808	348.89	2,026,353.12
CARMAX INC	13,891	124.24	1,725,817.84
CARVANA CO	5,700	349.95	1,994,715.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	89.70	616,956.60

DOLLAR GENERAL CORP	20,962	232.47	4,873,036.14
DOLLAR TREE INC	20,151	101.06	2,036,460.06
EBAY	56,933	72.83	4,146,430.39
ETSY INC	11,000	192.28	2,115,080.00
GENUINE PARTS CO	12,119	122.50	1,484,577.50
HOME DEPOT	90,952	322.90	29,368,400.80
LKQ CORP	26,705	50.83	1,357,415.15
LOWES COMPANIES	61,610	202.59	12,481,569.90
MERCADOLIBRE INC	3,770	1,759.96	6,635,049.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,067	602.13	3,653,122.71
POOL CORP	3,304	484.37	1,600,358.48
ROSS STORES INC	29,776	126.58	3,769,046.08
TARGET (DAYTON HUDSON)	42,191	245.41	10,354,093.31
TJX COMPANIES INC	103,121	73.59	7,588,674.39
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,932	194.94	1,936,144.08
ULTA BEAUTY INC	4,520	360.86	1,631,087.20
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	283.69	1,702,140.00
COSTCO WHOLESALE CORP	37,370	454.26	16,975,696.20
KROGER CO	61,306	45.93	2,815,784.58
SYSCO CORP	43,568	75.55	3,291,562.40
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,310	47.55	3,010,390.50
WALMART INC	131,340	150.11	19,715,447.40
ALTRIA GROUP INC	156,266	48.24	7,538,271.84
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,339	59.32	2,867,469.48
BOSTON BEER COMPANY INC-A	744	597.86	444,807.84
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	68.83	1,804,722.60
BUNGE LIMITED	11,604	74.47	864,149.88
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	43.20	685,540.80
COCA-COLA CO	345,573	56.86	19,649,280.78
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	57.34	882,691.96
CONAGRA BRANDS INC	41,157	33.54	1,380,405.78
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,180	213.88	3,032,818.40
GENERAL MILLS INC	53,282	60.13	3,203,846.66
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,532	180.25	2,258,893.00
HORMEL FOODS CORP	27,157	46.44	1,261,171.08
JM SMUCKER CO	9,145	132.38	1,210,615.10
KELLOGG CO	21,630	66.23	1,432,554.90
KEURIG DR PEPPER INC	59,596	34.89	2,079,304.44
KRAFT HEINZ CO/THE	57,338	36.83	2,111,758.54
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	65.73	849,494.52
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	87.48	1,844,778.24
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	48.05	874,654.15

MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	118,747	63.68	7,561,808.96
MONSTER BEVERAGE CORP	34,258	97.18	3,329,192.44
PEPSICO INC	116,436	158.91	18,502,844.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	131,310	101.42	13,317,460.20
TYSON FOODS INC	25,074	80.29	2,013,191.46
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	86.39	1,818,941.45
CLOROX COMPANY	10,830	171.10	1,853,013.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,648	78.97	5,342,162.56
ESTEE LAUDER CO-CL A	19,298	327.40	6,318,165.20
KIMBERLY-CLARK CORP	28,913	138.91	4,016,304.83
PROCTER & GAMBLE CO	208,024	144.99	30,161,399.76
ABBOTT LABORATORIES	149,509	125.72	18,796,271.48
ABIOMED INC	3,781	333.35	1,260,396.35
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,263	679.86	4,257,963.18
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	119.26	1,537,976.96
ANTHEM INC	20,600	375.90	7,743,540.00
BAXTER INTERNATIONAL	44,024	75.02	3,302,680.48
BECTON DICKINSON & CO	24,401	247.88	6,048,519.88
BOSTON SCIENTIFIC CORP	118,882	44.27	5,262,906.14
CARDINAL HEALTH	24,692	51.32	1,267,193.44
CENTENE CORP	48,540	63.91	3,102,191.40
CERNER CORP	25,323	79.62	2,016,217.26
CIGNA CORP	30,245	206.18	6,235,914.10
CVS HEALTH CORP	110,398	84.23	9,298,823.54
DANAHER CORP	54,077	319.79	17,293,283.83
DAVITA INC	5,784	132.15	764,355.60
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	59.88	1,064,307.12
DEXCOM INC	8,037	505.55	4,063,105.35
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53,513	117.95	6,311,858.35
HCA HEALTHCARE INC	23,291	246.50	5,741,231.50
HENRY SCHEIN INC	11,747	75.76	889,952.72
HOLOGIC INC	21,687	76.56	1,660,356.72
HUMANA INC	11,040	413.69	4,567,137.60
IDEXX LABORATORIES INC	7,161	681.71	4,881,725.31
INSULET CORP	5,923	294.81	1,746,159.63
INTUITIVE SURGICAL INC	9,913	1,055.64	10,464,559.32
LABORATORY CRP OF AMER	8,285	302.77	2,508,449.45
MASIMO CORP	4,835	278.04	1,344,323.40
MCKESSON CORP	13,893	199.26	2,768,319.18
MEDTRONIC PLC	113,657	128.93	14,653,797.01
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	263.00	1,299,220.00
NOVOCURE LTD	7,933	128.86	1,022,246.38

OAK STREET HEALTH INC	7,613	45.14	343,650.82
QUEST DIAGNOSTICS	11,335	151.60	1,718,386.00
RESMED INC	12,370	283.03	3,501,081.10
STERIS PLC	7,163	214.89	1,539,257.07
STRYKER CORP	28,475	264.32	7,526,512.00
TELADOC HEALTH INC	11,375	135.60	1,542,450.00
TELEFLEX INC	3,934	375.84	1,478,554.56
THE COOPER COS INC	4,134	442.04	1,827,393.36
UNITEDHEALTH GROUP INC	80,170	427.89	34,303,941.30
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	150.85	1,093,360.80
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,775	317.89	3,743,154.75
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,317	446.96	2,823,446.32
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,300	144.12	2,493,276.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	154.16	871,774.80
ABBVIE INC	149,024	117.93	17,574,400.32
AGILENT TECHNOLOGIES	26,029	167.67	4,364,282.43
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	196.99	1,899,574.57
AMGEN	48,679	224.39	10,923,080.81
AVANTOR INC	42,980	38.83	1,668,913.40
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	776.25	1,438,391.25
BIO-TECHNE CORP	3,245	475.88	1,544,230.60
BIOGEN INC	12,750	338.62	4,317,405.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	74.77	1,105,324.91
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	188,895	68.51	12,941,196.45
CATALENT INC	15,232	120.90	1,841,548.80
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	420.33	1,767,067.32
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	31.50	1,135,921.50
EXACT SCIENCES CORP	14,756	90.24	1,331,581.44
GILEAD SCIENCES INC	105,658	71.67	7,572,508.86
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	103.23	1,850,500.98
ILLUMINA INC	12,501	470.36	5,879,970.36
INCYTE CORP	15,212	74.51	1,133,446.12
IQVIA HOLDINGS INC	16,036	256.66	4,115,799.76
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	131.51	653,736.21
JOHNSON & JOHNSON	222,152	178.57	39,669,682.64
LILLY (ELI) & CO	68,743	270.40	18,588,107.20
MERCK & CO	213,503	78.46	16,751,445.38
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,051	1,541.60	3,161,821.60
MODERNA INC	27,089	375.53	10,172,732.17
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	89.54	758,761.96
NOVAVAX INC	5,754	217.47	1,251,322.38
PERKINELMER INC	9,372	181.77	1,703,548.44

PFIZER	470,870	48.80	22,978,456.00
PPD INC	11,027	46.03	507,572.81
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,829	655.63	5,788,557.27
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	38.88	603,961.92
SEAGEN INC	11,471	158.09	1,813,450.39
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.22	741,297.22
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,232	551.88	18,340,076.16
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,458	195.04	4,380,208.32
VIATRIS INC	103,541	14.73	1,525,158.93
WATERS CORP	5,228	404.86	2,116,608.08
ZOETIS INC	39,976	206.44	8,252,645.44
BANK OF AMERICA CORP	656,214	40.19	26,373,240.66
CITIGROUP	175,488	69.84	12,256,081.92
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	41.88	1,509,397.08
FIFTH THIRD BANCORP	61,361	37.37	2,293,060.57
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,827	194.46	2,883,258.42
HUNTINGTON BANCSHARES INC	127,582	14.62	1,865,248.84
JPMORGAN CHASE & CO	257,893	154.28	39,787,732.04
KEY CORP	83,212	19.74	1,642,604.88
M & T BANK CORP	10,537	134.66	1,418,912.42
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,597	184.34	6,561,950.98
REGIONS FINL CORP	81,824	19.67	1,609,478.08
SVB FINANCIAL GROUP	4,393	542.65	2,383,861.45
TRUIST FINANCIAL CORP	115,723	55.04	6,369,393.92
US BANCORP	122,617	55.34	6,785,624.78
WELLS FARGO & CO	348,776	47.25	16,479,666.00
ALLY FINANCIAL INC	31,445	51.21	1,610,298.45
AMERICAN EXPRESS	57,665	159.03	9,170,464.95
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,185	260.36	2,651,766.60
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	55.97	848,113.41
BANK NEW YORK CO	71,298	52.77	3,762,395.46
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	115,834	285.13	33,027,748.42
BLACKROCK INC	12,861	903.78	11,623,514.58
BLACKSTONE INC	58,748	110.37	6,484,016.76
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,568	168.10	6,483,280.80
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	46.27	582,770.65
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	127.62	1,132,627.50
CME GROUP INC	30,156	198.08	5,973,300.48
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,121	125.81	3,286,283.01
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	29.67	973,621.05
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	365.16	1,149,523.68
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	30.65	799,045.50

FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	86.30	372,470.80
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,134	393.57	11,466,268.38
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,143	116.38	5,486,502.34
INVESCO LTD	35,765	23.42	837,616.30
KKR & CO INC	43,643	62.20	2,714,594.60
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	472.27	1,514,569.89
MOODY'S CORP	14,125	374.54	5,290,377.50
MORGAN STANLEY	118,951	99.73	11,862,983.23
MSCI INC	6,908	610.00	4,213,880.00
NASDAQ INC	9,657	188.02	1,815,709.14
NORTHERN TRUST CORP	17,625	113.63	2,002,728.75
PRICE T ROWE GROUP INC	19,057	212.47	4,049,040.79
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,324	133.16	1,374,743.84
S&P GLOBAL INC	20,253	433.94	8,788,586.82
SCHWAB (CHARLES) CORP	121,361	71.06	8,623,912.66
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	60.52	577,966.00
STATE STREET CORP	29,894	85.50	2,555,937.00
SYNCHRONY FINANCIAL	49,509	49.01	2,426,436.09
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	85.75	776,980.75
VOYA FINANCIAL INC	10,050	64.13	644,506.50
AFLAC	54,481	55.92	3,046,577.52
ALLEGHANY CORP	1,276	691.25	882,035.00
ALLSTATE CORP	26,425	134.03	3,541,742.75
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	134.36	849,020.84
AMERICAN INT'L GROUP	75,227	52.96	3,984,021.92
AON PLC	19,359	276.07	5,344,439.13
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	41.66	1,417,731.46
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	142.00	2,322,978.00
ASSURANT INC	4,726	163.54	772,890.04
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	62.24	635,283.68
BROWN & BROWN INC	19,873	56.86	1,129,978.78
CHUBB LTD	38,652	185.44	7,167,626.88
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	121.69	1,556,536.79
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	173.06	374,847.96
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	271.43	892,461.84
FNF GROUP	24,961	48.34	1,206,614.74
GLOBE LIFE INC	8,106	94.87	769,016.22
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,371	65.93	2,002,360.03
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	65.40	1,070,205.60
LOEWS CORP	18,851	54.65	1,030,207.15
MARKEL CORP	1,156	1,255.35	1,451,184.60
MARSH & MCLENNAN COS	42,677	153.92	6,568,843.84

METLIFE INC	64,294	60.28	3,875,642.32
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	64.59	1,490,220.48
PROGRESSIVE CORP	50,582	96.20	4,865,988.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,127	103.79	3,438,251.33
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,652	118.07	785,401.64
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	163.72	796,334.08
TRAVELERS COS INC/THE	21,022	159.48	3,352,588.56
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,021	214.32	2,362,020.72
WR BERKLEY CORP	11,715	75.57	885,302.55
CBRE GROUP INC-A	27,882	91.76	2,558,452.32
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.22	416,514.00
WEYERHAEUSER CO	63,665	33.91	2,158,880.15
ACCENTURE PLC-CL A	53,519	328.25	17,567,611.75
ADOBE INC	40,430	637.66	25,780,593.80
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	113.02	1,545,322.46
ANSYS INC	7,474	357.72	2,673,599.28
AUTODESK INC	18,457	330.35	6,097,269.95
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,984	211.12	7,596,942.08
AVALARA INC	7,698	165.88	1,276,944.24
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	63.79	892,804.84
BLACK KNIGHT INC	14,413	75.15	1,083,136.95
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	173.73	1,692,477.66
CADENCE DESIGN SYSTEMS	23,282	153.27	3,568,432.14
CERIDIAN HCM HOLDING INC	12,296	105.22	1,293,785.12
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	124.94	1,310,120.84
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	102.48	1,070,301.12
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,762	118.15	2,098,580.30
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,007	75.79	3,486,870.53
COUPA SOFTWARE INC	6,059	210.25	1,273,904.75
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,957	234.96	3,514,296.72
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	155.39	481,709.00
DATADOG INC - CLASS A	14,371	132.42	1,903,007.82
DOCUSIGN INC	15,540	286.84	4,457,493.60
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	30.14	869,388.30
DYNATRACE INC	14,790	62.02	917,275.80
EPAM SYSTEMS INC	4,753	619.56	2,944,768.68
FAIR ISAAC CORP	2,615	447.16	1,169,323.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	52,242	128.87	6,732,426.54
FISERV INC	51,693	116.25	6,009,311.25
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,523	255.15	1,664,343.45
FORTINET INC	11,565	295.78	3,420,695.70
GARTNER INC	7,500	302.66	2,269,950.00

GLOBAL PAYMENTS INC	25,292	163.00	4,122,596.00
GODADDY INC - CLASS A	13,798	70.21	968,757.58
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,318	110.48	698,012.64
HUBSPOT INC	3,646	648.08	2,362,899.68
INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,281	138.02	10,390,283.62
INTUIT INC	23,082	543.44	12,543,682.08
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	176.29	1,109,040.39
MASTERCARD INC-CLASS A	74,900	357.31	26,762,519.00
MICROSOFT CORP	606,107	296.77	179,874,374.39
MONGODB INC	4,623	364.90	1,686,932.70
NORTONLIFELOCK INC	50,376	25.83	1,301,212.08
OKTA INC	10,230	230.91	2,362,209.30
ORACLE CORP	161,383	88.71	14,316,285.93
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	43,290	24.16	1,045,886.40
PALO ALTO NETWORKS INC	8,311	362.90	3,016,061.90
PAYCHEX INC	27,703	115.26	3,193,047.78
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	457.08	1,935,733.80
PAYPAL HOLDINGS INC	93,989	270.58	25,431,543.62
PTC INC	9,984	126.25	1,260,480.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	250.99	1,604,579.07
SALESFORCE.COM INC	82,450	253.07	20,865,621.50
SERVICENOW INC	16,513	586.92	9,691,809.96
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,960	279.45	547,722.00
SPLUNK INC	13,355	141.27	1,886,660.85
SQUARE INC - A	33,292	257.35	8,567,696.20
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	75.04	1,450,898.40
SYNOPSYS INC	12,728	315.99	4,021,920.72
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35,780	75.79	2,711,766.20
TWILIO INC - A	13,692	341.27	4,672,668.84
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	470.46	1,570,865.94
UNITY SOFTWARE INC	4,329	116.41	503,938.89
VERISIGN INC	8,760	211.84	1,855,718.40
VISA INC-CLASS A SHARES	143,326	231.57	33,190,001.82
VMWARE INC-CLASS A	6,812	153.07	1,042,712.84
WESTERN UNION CO	38,757	21.67	839,864.19
WIX.COM LTD	5,010	216.45	1,084,414.50
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	231.90	3,595,609.50
ZENDESK INC	10,500	120.01	1,260,105.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,545	332.38	5,831,607.10
ZSCALER INC	6,234	244.88	1,526,581.92
AMPHENOL CORPORATION	51,451	74.12	3,813,548.12
APPLE INC	1,420,191	146.70	208,342,019.70

ARISTA NETWORKS INC	4,720	366.84	1,731,484.80
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	116.33	709,613.00
CDW CORP/DE	11,982	194.33	2,328,462.06
CISCO SYSTEMS	356,369	57.27	20,409,252.63
COGNEX CORP	14,352	83.56	1,199,253.12
CORNING	64,989	40.89	2,657,400.21
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	96.22	2,071,616.60
F5 NETWORKS INC	5,350	197.95	1,059,032.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	14.38	1,569,562.62
HP INC	106,353	27.78	2,954,486.34
IPG PHOTONICS CORP	3,207	168.17	539,321.19
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	29.02	908,442.08
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16,004	166.69	2,667,706.76
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,091	237.41	3,345,344.31
NETAPP INC	18,303	79.26	1,450,695.78
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,940	88.14	1,581,231.60
TE CONNECTIVITY LTD	27,668	147.02	4,067,749.36
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	88.93	1,883,181.68
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	59.57	1,536,310.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,612	562.72	2,595,264.64
AT&T INC	601,777	27.53	16,566,920.81
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	27.29	423,431.64
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	27.38	922,158.40
LUMEN TECHNOLOGIES INC	86,131	11.34	976,725.54
T-MOBILE US INC	52,257	140.89	7,362,488.73
VERIZON COMMUNICATIONS	349,306	55.37	19,341,073.22
AES CORP	54,375	23.64	1,285,425.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	61.48	1,277,431.44
AMEREN CORPORATION	20,898	89.57	1,871,833.86
AMERICAN ELECTRIC POWER	41,494	90.40	3,751,057.60
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,464	181.77	2,810,891.28
ATMOS ENERGY CORP	11,419	98.64	1,126,370.16
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	25.92	1,248,359.04
CMS ENERGY CORP	23,697	64.01	1,516,844.97
CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	76.69	2,204,454.05
DOMINION ENERGY INC	69,073	79.06	5,460,911.38
DTE ENERGY COMPANY	16,240	120.17	1,951,560.80
DUKE ENERGY CORP	66,012	106.88	7,055,362.56
EDISON INTL	32,117	58.20	1,869,209.40
ENTERGY CORP	16,926	111.79	1,892,157.54
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	48.80	1,016,699.20
EVERGY INC	18,475	68.60	1,267,385.00

EVERSOURCE ENERGY	29,303	91.18	2,671,847.54	
EXELON CORP	81,616	48.79	3,982,044.64	
FIRSTENERGY CORP	45,787	38.94	1,782,945.78	
NEXTERA ENERGY INC	165,232	84.55	13,970,365.60	
NISOURCE INC	35,781	25.50	912,415.50	
NRG ENERGY INC	23,078	42.67	984,738.26	
PG&E CORP	135,327	8.93	1,208,470.11	
PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	80.08	862,621.76	
PPL CORPORATION	63,429	29.19	1,851,492.51	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,258	64.26	2,779,759.08	
SEMPRA ENERGY	27,056	131.97	3,570,580.32	
SOUTHERN CO	88,673	66.38	5,886,113.74	
UGI CORP	18,019	46.23	833,018.37	
VISTRA CORP	37,797	17.80	672,786.60	
WEC ENERGY GROUP INC	26,821	96.97	2,600,832.37	
XCEL ENERGY INC	46,423	70.12	3,255,180.76	
ADVANCED MICRO DEVICES	102,014	103.70	10,578,851.80	
ANALOG DEVICES	30,929	166.79	5,158,647.91	
APPLIED MATERIALS	77,306	129.20	9,987,935.20	
BROADCOM INC	34,444	473.53	16,310,267.32	
ENPHASE ENERGY INC	10,113	162.89	1,647,306.57	
INTEL CORP	342,906	52.44	17,981,990.64	
KLA CORP	12,889	322.35	4,154,769.15	
LAM RESEARCH CORP	12,019	577.14	6,936,645.66	
MARVELL TECHNOLOGY INC	66,930	58.98	3,947,531.40	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,641	101.81	2,305,080.21	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,404	144.25	3,231,777.00	
MICRON TECHNOLOGY	94,036	70.28	6,608,850.08	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	467.22	1,649,753.82	
NVIDIA CORP	209,265	197.98	41,430,284.70	
NXP SEMICONDUCTORS NV	23,203	203.02	4,710,673.06	
ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	40.98	1,475,116.08	
QORVO INC	9,678	180.13	1,743,298.14	
QUALCOMM	95,794	140.61	13,469,594.34	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,359	177.23	2,544,845.57	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,600	262.30	1,206,580.00	
TERADYNE INC	14,398	114.21	1,644,395.58	
TEXAS INSTRUMENTS	77,615	185.04	14,361,879.60	
XILINX INC	20,982	142.51	2,990,144.82	
アメリカドル 小計	26,462,541		3,288,118,668.67 (361,331,360,500)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	20.04	538,675.20

CANADIAN NATURAL RESOURCES	102,786	39.01	4,009,681.86
CENOVUS ENERGY INC	96,666	9.50	918,327.00
ENBRIDGE	173,165	47.87	8,289,408.55
IMPERIAL OIL	24,763	31.43	778,301.09
INTER PIPELINE LTD	35,455	19.97	708,036.35
KEYERA CORP	18,607	29.48	548,534.36
PARKLAND CORP	14,075	36.25	510,218.75
PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	38.53	1,759,510.98
SUNCOR ENERGY	132,181	22.53	2,978,037.93
TC ENERGY CORP	77,108	58.65	4,522,384.20
AGNICO EAGLE MINES	20,293	71.77	1,456,428.61
B2GOLD CORP	90,243	4.74	427,751.82
BARRICK GOLD CORP	153,589	24.50	3,762,930.50
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	70.44	925,511.16
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,000	23.17	1,274,350.00
FRANCO-NEVADA CORP	15,363	183.18	2,814,194.34
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	8.87	459,882.89
KINROSS GOLD CORP	108,451	7.26	787,354.26
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	48.63	1,139,303.64
LUNDIN MINING CORP	62,243	9.70	603,757.10
NUTRIEN LTD	48,966	74.48	3,646,987.68
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	30.92	569,268.12
TECK RESOURCES LTD-CL B	40,561	25.42	1,031,060.62
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	87.91	685,698.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,528	54.48	2,153,485.44
YAMANA GOLD INC	81,672	5.38	439,395.36
BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	19.28	380,278.72
CAE INC	25,999	34.38	893,845.62
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	108.61	836,840.05
WSP GLOBAL INC	8,602	161.81	1,391,889.62
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	42.59	575,177.95
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	78.43	803,515.35
THOMSON REUTERS CORP	15,013	144.69	2,172,230.97
AIR CANADA	13,805	23.60	325,798.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,870	136.55	8,311,798.50
CP RAILWAY LIMITED	57,581	90.81	5,228,930.61
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	99.49	2,316,326.18
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	47.52	811,594.08
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	80.45	1,856,222.85
QUEBECOR INC -CL B	15,200	30.91	469,832.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	36.54	1,294,319.88
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	192.38	1,040,583.42

DOLLARAMA INC	26,700	59.18	1,580,106.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	74,153	51.80	3,841,125.40
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	41.35	630,711.55
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	89.03	1,149,644.39
METRO INC	18,840	63.77	1,201,426.80
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	135.76	934,436.08
SAPUTO INC	24,489	35.27	863,727.03
BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	35.77	994,406.00
CANOPY GROWTH CORP	20,989	21.16	444,127.24
BANK MONTREAL	53,539	126.79	6,788,209.81
BANK NOVA SCOTIA	100,660	79.61	8,013,542.60
CANADIAN IMPERIAL BANK	38,790	146.85	5,696,311.50
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	97.43	2,658,767.27
ROYAL BANK OF CANADA	119,310	130.35	15,552,058.50
TORONTO-DOMINION BANK	151,853	85.57	12,994,061.21
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	106,335	70.04	7,447,703.40
IGM FINANCIAL INC	7,685	45.16	347,054.60
ONEX CORP	6,603	86.57	571,621.71
TMX GROUP LTD	4,685	138.75	650,043.75
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	565.71	1,206,659.43
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	39.56	941,053.28
IA FINANCIAL CORP INC	10,099	72.91	736,318.09
INTACT FINANCIAL CORP	13,043	176.05	2,296,220.15
MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	24.81	4,045,419.36
POWER CORP OF CANADA	43,577	42.37	1,846,357.49
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,702	66.13	3,352,923.26
FIRSTSERVICE CORP	3,690	237.23	875,378.70
BLACKBERRY LIMITED	39,400	12.26	483,044.00
CGI INC - CL A	18,428	112.43	2,071,860.04
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	2,097.09	3,483,266.49
LIGHTSPEED COMMERCE INC	8,296	115.68	959,681.28
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	129.03	554,958.03
OPEN TEXT CORP	24,643	67.43	1,661,677.49
SHOPIFY INC - CLASS A	9,429	1,881.10	17,736,891.90
BCE INC	6,203	64.79	401,892.37
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,584	63.42	1,939,637.28
TELUS CORP	32,908	28.76	946,434.08
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	19.75	1,023,405.50
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	24.89	607,191.55
ATCO LTD -CLASS I	5,241	42.91	224,891.31
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	53.03	598,973.85
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	36.01	371,767.24

	EMERA INC	18,723	59.69	1,117,575.87
	FORTIS INC	36,823	58.34	2,148,253.82
	HYDRO ONE LTD	32,299	31.68	1,023,232.32
	NORTHLAND POWER INC	17,854	41.07	733,263.78
	カナダドル 小計	3,469,882		202,194,972.41 (17,336,196,934)
ユーロ	ENI	218,529	10.07	2,201,898.20
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	8.31	409,097.30
	NESTE OIL OYJ	37,233	48.49	1,805,428.17
	OMV AG	12,549	45.27	568,093.23
	REPSOL SA	127,332	9.28	1,182,404.95
	TENARIS SA	40,648	8.22	334,126.56
	TOTALENERGIES SE	208,459	36.30	7,568,103.99
	VOPAK	6,360	36.06	229,341.60
	AIR LIQUIDE	40,492	151.64	6,140,206.88
	AKZO NOBEL	15,301	102.75	1,572,177.75
	ARCELORMITTAL	61,651	27.85	1,716,980.35
	ARKEMA	5,949	105.85	629,701.65
	BASF SE	78,752	65.52	5,159,831.04
	COVESTRO AG	17,254	53.42	921,708.68
	CRH PLC	64,773	43.54	2,820,216.42
	EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	28.43	561,606.22
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	42.56	245,230.72
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	72.40	944,168.40
	KONINKLIJKE DSM NV	14,947	180.30	2,694,944.10
	LANXESS	7,293	58.76	428,536.68
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	48.85	952,770.40
	SOLVAY SA	6,906	112.45	776,579.70
	STORA ENSO OYJ R	42,169	16.22	683,981.18
	SYMRISE AG	11,456	124.80	1,429,708.80
	UMICORE	17,605	57.00	1,003,485.00
	UPM KYMMENE OYJ	45,603	34.26	1,562,358.78
	VOESTALPINE AG	7,152	38.22	273,349.44
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	20,729	22.75	471,584.75
	AIRBUS SE	50,151	110.04	5,518,616.04
	ALSTOM	24,388	36.78	896,990.64
	BOUYGUES ORD	21,446	35.12	753,183.52
	BRENTAG SE	12,514	85.38	1,068,445.32
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	13.69	1,109,245.94
	DASSAULT AVIATION SA	213	945.00	201,285.00
	EIFFAGE	7,964	84.76	675,028.64
	FERROVIAL SA	41,438	24.83	1,028,905.54

GEA GROUP AG	13,382	37.95	507,846.90
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	93.84	1,163,428.32
KION GROUP AG	5,887	88.64	521,823.68
KNORR-BREMSE AG	6,822	100.05	682,541.10
KONE OYJ-B	29,051	69.80	2,027,759.80
LEGRAND SA	21,768	96.68	2,104,530.24
MTU AERO ENGINES AG	4,753	198.35	942,757.55
PRYSMIAN SPA	21,155	31.94	675,690.70
RATIONAL AG	483	913.80	441,365.40
SAFRAN SA	28,410	104.32	2,963,731.20
SAINT-GOBAIN	43,973	62.08	2,729,843.84
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,808	153.68	6,886,093.44
SIEMENS	63,910	138.70	8,864,317.00
SIEMENS ENERGY AG	36,181	23.79	860,745.99
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	25.28	567,156.80
THALES SA	9,665	84.32	814,952.80
VINCI S.A.	45,934	90.61	4,162,079.74
WARTSILA OYJ	41,917	11.74	492,315.16
BUREAU VERITAS SA	25,073	27.70	694,522.10
RANDSTAD NV	11,218	60.98	684,073.64
TELEPERFORMANCE	4,734	365.60	1,730,750.40
WOLTERS KLUWER	22,949	96.38	2,211,824.62
ADP	2,382	100.10	238,438.20
AENA SME SA	6,542	136.90	895,599.80
ATLANTIA SPA	46,597	15.76	734,368.72
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	8.78	204,397.97
DEUTSCHE POST AG-REG	81,964	59.70	4,893,250.80
GETLINK	29,362	13.90	408,278.61
INPOST SA	12,480	15.88	198,257.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,684	77.43	2,221,002.12
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	67.05	334,646.55
CONTINENTAL AG	9,928	112.64	1,118,289.92
DAIMLER AG	73,367	69.62	5,107,810.54
FAURECIA	10,948	42.12	461,129.76
FERRARI NV	10,170	182.20	1,852,974.00
MICHELIN	13,839	141.65	1,960,294.35
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	82.52	969,197.40
RENAULT SA	17,362	31.50	546,989.81
STELLANTIS NV	170,174	17.34	2,950,817.16
VALEO SA	21,538	24.17	520,573.46
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,167	194.84	2,955,138.28
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	281.20	699,063.20

ADIDAS AG	16,242	303.35	4,927,010.70
ESSILORLUXOTTICA	23,442	160.04	3,751,657.68
HERMES INTERNATIONAL	2,731	1,220.00	3,331,820.00
KERING	6,205	650.00	4,033,250.00
LVMH	23,334	613.10	14,306,075.40
MONCLER SPA	14,361	54.90	788,418.90
PUMA SE	9,220	106.05	977,781.00
SEB SA	2,282	134.90	307,841.80
ACCOR	14,436	28.13	406,084.68
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,518	159.20	2,311,265.60
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	43.13	349,698.04
SODEXO	8,135	69.58	566,033.30
BOLLORE	83,646	4.83	404,177.47
PUBLICIS GROUPE	17,077	52.80	901,665.60
SCOUT24 AG	7,492	70.56	528,635.52
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	51.68	365,429.28
VIVENDI SE	61,243	30.92	1,893,633.56
DELIVERY HERO SE	13,414	116.60	1,564,072.40
HELLOFRESH SE	13,805	94.54	1,305,124.70
INDITEX	95,060	29.13	2,769,097.80
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	79.46	1,237,351.12
PROSUS	78,855	68.62	5,411,030.10
ZALANDO SE	17,664	92.48	1,633,566.72
CARREFOUR	52,544	17.14	900,604.16
COLRUYT SA	5,424	48.33	262,141.92
JERONIMO MARTINS	24,901	18.05	449,463.05
KESKO OYJ-B SHS	25,583	36.63	937,105.29
KONINKLIJKE AHOLD NV	87,400	28.75	2,513,187.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,788	50.85	3,243,619.80
DANONE (GROUPE)	54,643	63.82	3,487,316.26
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	11.70	574,200.90
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	78.55	840,563.55
HEINEKEN NV	22,407	92.98	2,083,402.86
JDE PEET'S BV	7,000	29.83	208,810.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	124.50	1,624,725.00
PERNOD-RICARD	18,224	177.70	3,238,404.80
REMY COINTREAU	2,382	166.50	396,603.00
BEIERSDORF AG	9,190	105.20	966,788.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	77.00	676,060.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	82.60	1,192,661.40
LOREAL	21,038	388.80	8,179,574.40
AMPLIFON SPA	11,650	43.26	503,979.00

BIOMERIEUX	4,175	105.20	439,210.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	185.55	636,436.50
DIASORIN SPA	2,070	185.05	383,053.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,472	68.54	1,197,530.88
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	46.03	1,550,873.11
KONINKLIJKE PHILIPS	77,215	37.73	2,913,321.95
ORPEA	4,336	103.15	447,258.40
SARTORIUS AG-VORZUG	2,224	551.40	1,226,313.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	20,758	59.78	1,240,913.24
ARGENX SE	4,178	267.10	1,115,943.80
BAYER	83,832	47.64	3,994,175.64
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	118.30	1,209,026.00
GRIFOLS SA	27,685	21.38	591,905.30
IPSEN	3,532	83.28	294,144.96
MERCK KGAA	10,555	202.90	2,141,609.50
ORION OYJ-CLASS B	9,854	34.50	339,963.00
QIAGEN N.V.	17,038	45.53	775,740.14
RECORDATI SPA	9,859	57.06	562,554.54
SANOFI	94,644	90.17	8,534,049.48
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	496.40	1,200,791.60
UCB (GROUPE)	9,389	99.30	932,327.70
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	11.56	461,806.12
BANCO BILBAO VIZCAYA	576,942	5.58	3,224,528.83
BANCO SANTANDER SA	1,470,387	3.07	4,517,764.05
BNP PARIBAS	93,068	51.91	4,831,159.88
CAIXABANK	380,168	2.57	978,172.26
COMMERZBANK AG	94,388	5.18	488,929.84
CREDIT AGRICOLE SA	89,515	11.73	1,050,010.95
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	33.64	804,164.20
FINECOBANK SPA	53,120	15.93	846,467.20
ING GROEP NV-CVA	320,768	11.29	3,624,036.86
INTESA SANPAOLO	1,346,514	2.35	3,173,060.24
KBC GROEP NV	21,052	69.66	1,466,482.32
MEDIOBANCA	53,990	9.86	532,341.40
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	20.54	256,544.60
SOCIETE GENERALE	67,846	25.75	1,747,034.50
UNICREDIT SPA	189,030	10.12	1,914,495.84
AMUNDI SA	6,226	78.45	488,429.70
DEUTSCHE BANK NAMEN	177,263	10.49	1,859,488.87
DEUTSCHE BOERSE	16,510	150.35	2,482,278.50
EURAZEO SA	3,357	86.55	290,548.35
EXOR NV	10,345	70.94	733,874.30

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	96.70	823,400.50
SOFINA	1,238	379.60	469,944.80
WENDEL	2,023	121.00	244,783.00
AEGON	166,267	4.16	692,335.78
AGEAS	16,065	43.30	695,614.50
ALLIANZ SE-REG	34,366	198.02	6,805,155.32
ASSICURAZIONI GENERALI	97,567	17.07	1,665,468.69
AXA SA	166,887	23.92	3,992,771.47
CNP ASSURANCES	16,287	14.06	228,995.22
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,333	156.55	678,331.15
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,376	254.95	2,900,311.20
NN GROUP NV	22,611	43.83	991,040.13
POSTE ITALIANE SPA	46,035	11.49	529,172.32
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	43.40	1,869,455.00
SCOR SE	13,354	25.61	341,995.94
AROUNDTOWN SA	94,068	6.75	635,335.27
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,092	52.92	1,486,628.64
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	137.75	726,631.25
VONOVIA SE	45,080	60.04	2,706,603.20
ADYEN NV	1,666	2,523.50	4,204,151.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,094	50.98	1,993,012.12
ATOS SE	9,750	42.53	414,667.50
BECHTLE AG	7,659	58.84	450,655.56
CAPGEMINI SA	13,914	189.65	2,638,790.10
DASSAULT SYSTEMES SA	57,125	47.80	2,730,575.00
EDENRED	18,664	48.27	900,911.28
NEMETSCHKE SE	5,455	80.60	439,673.00
NEXI SPA	41,348	17.58	727,104.58
SAP SE	87,453	125.76	10,998,089.28
TEAMVIEWER AG	14,174	27.60	391,202.40
WORLDLINE SA	20,332	75.00	1,524,900.00
NOKIA OYJ	450,608	5.06	2,280,527.08
CELLNEX TELECOM SA	41,435	60.50	2,506,817.50
DEUTSCHE TELEKOM	285,034	18.57	5,294,221.51
ELISA A	13,387	55.46	742,443.02
ILIAD SA	1,253	182.00	228,046.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.12	307,395.00
KPN (KON.)	282,927	2.71	768,146.80
ORANGE	171,535	9.68	1,662,002.61
PROXIMUS	13,141	17.38	228,456.28
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.38	325,930.62
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.39	186,648.35

	TELEFONICA	456,377	4.24	1,937,776.74
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.41	238,100.58
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	36.39	346,178.07
	E.ON SE	185,377	11.27	2,089,569.54
	EDP RENOVAVEIS SA	21,466	21.84	468,817.44
	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.27	445,401.67
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	107.60	314,730.00
	ENAGAS	25,299	20.06	507,497.94
	ENDESA	25,972	20.80	540,217.60
	ENEL	692,930	7.92	5,489,391.46
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.75	1,073,455.51
	ENGIE	158,224	12.16	1,924,636.73
	FORTUM OYJ	32,550	24.89	810,169.50
	IBERDROLA SA	510,769	10.65	5,442,243.69
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	21.85	509,323.50
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	17.80	705,449.60
	RWE STAMM	55,390	32.82	1,817,899.80
	SNAM SPA	147,559	5.30	783,243.17
	SUEZ	32,549	19.65	639,750.59
	TERNA SPA	130,230	7.18	935,572.32
	UNIPER SE	7,335	33.13	243,008.55
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	28.72	1,247,223.44
	VERBUND AG	6,430	87.10	560,053.00
	ASM INTERNATIONAL NV	4,217	308.40	1,300,522.80
	ASML HOLDING NV	35,340	664.40	23,479,896.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	112,361	33.48	3,762,408.08
	STMICROELECTRONICS	55,076	35.85	1,974,474.60
	ユーロ 小計	16,046,743		412,404,035.23 (52,944,430,042)
イギリスポンド	BP PLC	1,696,535	2.87	4,881,779.46
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,807	13.84	4,732,659.72
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	308,298	13.75	4,240,947.28
	ANGLO AMERICAN PLC	108,946	29.12	3,172,507.52
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	14.05	503,776.80
	BHP GROUP PLC	175,556	21.63	3,798,154.06
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	91.70	1,001,730.80
	EVRAZ PLC	43,000	5.40	232,200.00
	GLENCORE PLC	823,141	3.07	2,527,866.01
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	29.77	501,564.96
	MONDI PLC	36,710	20.34	746,681.40
	RIO TINTO PLC REG	96,096	51.92	4,989,304.32
	ASHTREAD GROUP PLC	37,034	55.40	2,051,683.60

BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.70	1,482,592.80
BUNZL PLC	24,880	26.86	668,276.80
DCC PLC	9,127	60.10	548,532.70
FERGUSON PLC	19,417	100.70	1,955,291.90
MELROSE INDUSTRIES PLC	456,624	1.65	755,484.40
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.11	707,257.98
SMITHS GROUP PLC	37,146	14.17	526,544.55
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	156.65	863,768.10
EXPERIAN PLC	79,162	31.64	2,504,685.68
INTERTEK GROUP PLC	13,890	52.42	728,113.80
RELX PLC	166,847	21.72	3,623,916.84
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.77	811,693.44
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	7.11	686,087.52
BURBERRY GROUP PLC	29,776	18.12	539,690.00
PERSIMMON PLC	25,686	28.45	730,766.70
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.75	462,446.10
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,829	48.35	571,932.15
COMPASS GROUP PLC	155,632	14.66	2,282,343.28
ENTAIN PLC	49,630	18.43	914,929.05
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	44.75	717,834.75
WHITBREAD PLC	17,434	29.95	522,148.30
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.40	463,756.80
INFORMA PLC	141,175	5.31	749,639.25
PEARSON	66,305	7.56	501,531.02
WPP PLC	95,821	9.65	925,247.57
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	9.69	400,826.85
KINGFISHER PLC	198,587	3.54	704,388.08
NEXT PLC	11,468	78.18	896,568.24
OCADO GROUP PLC	44,612	18.97	846,512.70
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	2.79	584,552.66
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.89	428,984.82
TESCO PLC	666,000	2.44	1,625,040.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,490	19.95	668,125.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO	181,738	26.70	4,852,404.60
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	26.66	478,813.60
DIAGEO	195,886	35.67	6,987,253.62
IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	15.19	1,230,177.34
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,534	56.43	3,415,933.62
UNILEVER PLC	220,661	41.08	9,064,753.88
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	14.09	966,846.52
ASTRAZENECA	133,282	87.36	11,643,515.52
GLAXOSMITHKLINE	430,042	15.13	6,509,115.71

	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	25.68	422,538.72
	BARCLAYS	1,426,525	1.78	2,552,053.22
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,705,000	3.94	6,719,405.00
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,838,937	0.43	2,559,206.08
	NATWEST GROUP PLC	369,149	2.11	781,488.43
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	4.44	945,172.25
	3I GROUP PLC	88,121	13.10	1,154,385.10
	ABRDN PLC	210,980	2.63	555,088.38
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	14.86	491,553.94
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	79.96	2,206,256.32
	M&G PLC	229,107	2.09	480,895.59
	SCHRODERS PLC	11,794	36.19	426,824.86
	ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	15.91	651,259.94
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	36.72	596,883.60
	AVIVA PIC	332,730	4.14	1,378,833.12
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	3.06	348,763.90
	LEGAL & GENERAL GROUP	514,539	2.62	1,348,092.18
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.32	322,632.32
	PRUDENTIAL	225,330	14.47	3,260,525.10
	AVEVA GROUP PLC	10,917	40.58	443,011.86
	SAGE GROUP PLC	95,210	7.29	694,271.32
	HALMA PLC	31,069	29.75	924,302.75
	BT GROUP PLC	769,485	1.71	1,316,588.83
	VODAFONE GROUP PLC	2,206,986	1.21	2,675,308.42
	NATIONAL GRID PLC	306,760	9.78	3,001,033.08
	SEVERN TRENT PLC	22,468	28.51	640,562.68
	SSE PLC	92,294	16.46	1,519,620.71
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.75	630,027.90
	イギリスポンド 小計	24,422,580		148,975,766.27 (22,331,467,363)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	19.26	335,085.48
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	1,020.00	585,480.00
	GIVAUDAN-REG	795	4,602.00	3,658,590.00
	HOLCIM LTD	45,387	51.48	2,336,522.76
	SIKA AG-BR	11,766	325.20	3,826,303.20
	ABB LTD	149,042	34.30	5,112,140.60
	GEBERIT AG-REG	2,964	752.40	2,230,113.60
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	285.60	603,187.20
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	298.40	1,124,371.20
	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	50.58	737,102.34
	SGS SA	506	2,856.00	1,445,136.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	325.90	1,491,644.30

	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,541	99.34	4,325,362.94
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	255.00	633,165.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	49.50	194,931.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,358.00	660,240.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	104,600.00	1,046,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,430.00	855,260.00
	NESTLE SA - REGISTERED	243,137	116.18	28,247,656.66
	ALCON INC	42,603	73.76	3,142,397.28
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,677	354.90	1,659,867.30
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,697.00	1,449,238.00
	LONZA GROUP AG-REG	6,195	749.00	4,640,055.00
	NOVARTIS	187,008	85.41	15,972,353.28
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	410.20	1,148,149.80
	ROCHE HOLDING GENUSS	59,238	372.00	22,036,536.00
	VIFOR PHARMA AG	4,486	128.20	575,105.20
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	81.80	233,457.20
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.37	1,999,877.28
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	62.36	1,178,416.92
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,941	1,589.00	3,084,249.00
	UBS GROUP AG	315,017	15.18	4,781,958.06
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	148.90	649,501.80
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	479.10	1,364,955.90
	SWISS RE LTD	24,674	85.14	2,100,744.36
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,740	404.40	5,152,056.00
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	98.25	557,961.75
	TEMENOS AG - REG	5,150	141.30	727,695.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	95.32	1,399,869.52
	SWISSCOM	2,187	545.00	1,191,915.00
	スイスフラン 小計	1,479,172		134,494,651.93 (16,100,354,782)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	252.90	4,355,443.80
	BOLIDEN AB	23,903	299.00	7,146,997.00
	SCA SV CELLULOSA B	56,967	161.10	9,177,383.70
	ALFA LAVAL AB	27,268	350.30	9,551,980.40
	ASSA ABLOY AB-B	86,548	276.50	23,930,522.00
	ATLAS COPCO A	55,390	583.20	32,303,448.00
	ATLAS COPCO B	31,902	491.90	15,692,593.80
	EPIROC AB-A	58,039	185.00	10,737,215.00
	EPIROC AB-B	37,972	163.40	6,204,624.80
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	304.90	4,269,209.80
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	116.35	12,522,052.40
	SANDVIK AB	96,684	211.30	20,429,329.20

	SKANSKA B	25,507	246.90	6,297,678.30	
	SKF AB-B	35,405	212.30	7,516,481.50	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	195.10	2,636,581.40	
	VOLVO B	123,279	191.14	23,563,548.06	
	SECURITAS B	29,533	143.45	4,236,508.85	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	219.00	4,657,911.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	113.70	4,401,554.40	
	EVOLUTION AB	14,096	1,375.80	19,393,276.80	
	EMBRACER GROUP AB	18,755	193.05	3,620,652.75	
	HENNES & MAURITZ B	65,999	171.30	11,305,628.70	
	ICA GRUPPEN AB	9,493	438.50	4,162,680.50	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	78.68	10,013,603.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	280.30	13,867,562.20	
	NORDEA BANK ABP	280,957	100.76	28,309,227.32	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	114.15	15,806,350.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	131,166	97.10	12,736,218.60	
	SWEDBANK AB-A	72,526	166.78	12,095,886.28	
	EQT AB	20,102	430.00	8,643,860.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,115	314.80	3,184,202.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	303.10	3,385,020.80	
	INVESTOR AB-B SHS	157,664	206.90	32,620,681.60	
	KINNEVIK AB - B	18,792	344.40	6,471,964.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	595.20	4,333,056.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	632.00	5,972,400.00	
	SINCH AB	33,150	170.60	5,655,390.00	
	ERICSSON (LM) B	253,862	98.90	25,106,951.80	
	HEXAGON AB-B SHS	169,708	144.95	24,599,174.60	
	TELE2 AB-B SHS	32,829	130.30	4,277,618.70	
	TELIA CO AB	230,643	38.07	8,780,579.01	
	スウェーデンクローナ 小計	2,763,709		473,973,049.97 (5,915,183,663)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	76,370	180.86	13,812,278.20	
	NORSK HYDRO	126,800	57.60	7,303,680.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,408	447.60	7,344,220.80	
	ADEVINTA ASA	19,117	169.15	3,233,640.55	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	411.20	3,813,468.80	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	460.10	3,258,428.20	
	MOWI ASA	40,968	221.00	9,053,928.00	
	ORKLA	69,804	80.20	5,598,280.80	
	DNB BANK ASA	71,795	186.75	13,407,716.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	209.30	3,887,538.20	
	TELENOR ASA	51,193	158.05	8,091,053.65	

	ノルウェークローネ 小計	507,385		78,804,233.45 (958,259,478)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	577.80	4,901,477.40
	NOVOZYMES A/S	17,111	491.90	8,416,900.90
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	3,270.00	2,468,850.00
	VESTAS WIND SYSSEMS A/S	87,375	248.60	21,721,425.00
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	17,630.00	5,271,370.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	514	18,385.00	9,449,890.00
	DSV PANALPINA A S	17,354	1,579.50	27,410,643.00
	PANDORA A/S	8,163	785.80	6,414,485.40
	CARLSBERG AS-B	8,646	1,094.00	9,458,724.00
	AMBU A/S-B	13,555	192.50	2,609,337.50
	COLOPLAST-B	9,208	1,124.00	10,349,792.00
	DEMANT A/S	8,512	350.00	2,979,200.00
	GN STORE NORD A/S	11,967	473.50	5,666,374.50
	GENMAB A/S	5,192	2,969.00	15,415,048.00
	NOVO NORDISK A/S-B	145,274	670.30	97,377,162.20
	DANSKE BANK A/S	56,132	108.05	6,065,062.60
	TRYG A/S	29,772	160.20	4,769,474.40
ORSTED A/S	15,439	1,016.50	15,693,743.50	
	デンマーククローネ 小計	443,751		256,438,960.40 (4,426,136,456)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	27.40	565,234.60
	OIL SEARCH LTD	186,117	3.69	686,771.73
	SANTOS	156,437	6.01	940,186.37
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	33.11	424,238.43
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	19.60	1,458,318.40
	BHP GROUP LTD	245,638	44.67	10,972,649.46
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	24.35	846,649.50
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	4.02	491,059.08
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,483	20.13	2,787,662.79
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	52.71	1,947,529.08
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	25.54	1,892,462.92
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	9.41	956,319.48
	ORICA LTD	38,288	12.89	493,532.32
	RIO TINTO LTD	32,028	107.17	3,432,440.76
	SOUTH32 LTD	341,133	2.87	979,051.71
	REECE LTD	16,814	24.79	416,819.06
	BRAMBLES LTD	108,007	12.29	1,327,406.03
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	4.00	765,964.00
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.34	368,900.00
TRANSURBAN GROUP	233,493	13.96	3,259,562.28	

	ARISTOCRAT LEISURE LTD	44,067	42.63	1,878,576.21	
	CROWN RESORTS LTD	30,328	9.07	275,074.96	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	141.01	499,316.41	
	TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	4.82	877,302.66	
	REA GROUP LTD	5,276	155.70	821,473.20	
	SEEK LTD	31,593	31.05	980,962.65	
	WESFARMERS LTD	92,850	65.99	6,127,171.50	
	COLES GROUP LTD	115,478	18.57	2,144,426.46	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	7.15	785,792.15	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	109,901	41.50	4,560,891.50	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	12.50	881,725.00	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	256.09	1,224,878.47	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	66.54	1,081,141.92	
	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	42.40	1,699,222.40	
	CSL LIMITED	38,878	302.83	11,773,424.74	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	239,681	28.36	6,797,353.16	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	148,199	99.22	14,704,304.78	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	278,638	27.51	7,665,331.38	
	WESTPAC BANKING	302,673	25.82	7,815,016.86	
	ASX LTD	18,195	83.53	1,519,828.35	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,813	164.98	4,918,548.74	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	45.10	492,131.20	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	5.38	1,234,209.66	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.58	966,098.80	
	QBE INSURANCE GROUP	138,071	12.38	1,709,318.98	
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	12.32	1,470,441.28	
	AFTERPAY LTD	16,441	130.60	2,147,194.60	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	16.17	717,559.92	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	36.10	498,216.10	
	XERO LTD	11,340	147.89	1,677,072.60	
	TELSTRA CORP	308,467	3.97	1,224,613.99	
	AGL ENERGY LTD	64,235	7.20	462,492.00	
	AUSNET SERVICES	187,145	1.94	363,997.02	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.19	693,843.05	
	オーストラリアドル 小計	5,742,047		127,701,710.70 (10,037,354,461)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.07	833,347.97	
	A2 MILK CO LTD	66,854	6.94	463,966.76	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	33.65	1,834,598.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	14.52	527,322.84	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.77	826,638.45	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.80	439,368.40	

	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.09	563,221.68	
	ニュージーランドドル 小計	623,837		5,488,464.10 (412,073,884)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	57.50	13,196,020.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	117,500	165.80	19,481,500.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	28.85	4,962,200.00	
	MTR CORP	125,000	45.15	5,643,750.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	46.85	8,151,900.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	23.75	4,702,500.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	6.12	807,840.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	8.01	1,127,808.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	14.20	2,445,240.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	20.10	2,932,590.00	
	WH GROUP LTD	936,500	5.57	5,216,305.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	12.74	1,390,698.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	24.95	7,023,425.00	
	HANG SENG BANK	59,400	143.30	8,512,020.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	101,400	472.60	47,921,640.00	
	AIA GROUP LTD	1,020,200	97.65	99,622,530.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	52.00	8,553,792.00	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	23.05	3,618,850.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	20.45	3,537,850.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	35.40	4,433,071.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	37.00	5,045,875.00	
	SINO LAND CO	315,400	11.72	3,696,488.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	111.40	12,031,200.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	54.30	2,199,150.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	22.50	2,164,500.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	157,000	38.75	6,083,750.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	47.00	3,172,500.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	78.10	10,738,750.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	12.84	11,615,795.88	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	49.70	5,566,400.00	
	香港ドル 小計	6,809,912		315,595,938.48 (4,453,058,691)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.21	715,333.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.86	568,964.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	4.96	537,326.72	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.80	492,000.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.25	759,050.00	
	DBS GROUP	155,200	29.92	4,643,584.00	
	OCBC BANK	291,200	11.66	3,395,392.00	

	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	25.68	2,411,352.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	10.77	843,291.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.97	887,295.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.92	296,176.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.10	337,250.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	19.03	489,071.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.37	1,782,815.91	
	シンガポールドル 小計	2,896,975		18,158,900.63 (1,463,244,212)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	22.62	1,532,640.72	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	473.30	1,015,701.80	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	27.62	2,715,322.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	27.28	2,969,809.92	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	16.93	1,684,535.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	109.50	1,369,078.50	
	AZRIELI GROUP	4,323	280.00	1,210,440.00	
	NICE LTD	5,891	871.00	5,131,061.00	
	イスラエルシェケル 小計	399,293		17,628,589.14 (596,320,521)	
	合 計	92,067,827		498,305,440,987 (498,305,440,987)	

(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	114,413	1,126,968.05	
		LENDLEASE GROUP	64,786	761,235.50	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	961,533.72	
		オーストラリアドル 小計	303,750	2,849,737.27 (223,989,349)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,717,695.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,907,500.00	
		香港ドル 小計	595,500	5,625,195.00 (79,371,501)	
		投資信託受益証券合計	899,250	303,360,850 (303,360,850)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	735,534.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,251,139.49	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,437	10,824,534.18	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,055,253.34	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,025	2,692,998.75	

BOSTON PROPERTIES		13,029	1,470,583.23	
CAMDEN PROPERTY TRUST		8,788	1,291,484.48	
CROWN CASTLE INTL CORP		36,859	7,294,764.69	
DIGITAL REALTY TRUST INC		23,924	3,897,219.60	
DUKE REALTY CORP		31,540	1,596,239.40	
EQUINIX INC		7,500	6,254,700.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		14,090	1,173,415.20	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY		29,400	2,421,972.00	
ESSEX PROPERTY TRUST		5,510	1,755,761.50	
EXTRA SPACE STORAGE INC		10,868	1,918,202.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		45,265	1,591,064.75	
HOST HOTELS AND RESORTS INC		56,773	843,646.78	
INVITATION HOMES INC		46,840	1,883,904.80	
IRON MOUNTAIN INC		23,326	1,068,097.54	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		50,036	983,707.76	
MID-AMERICA APARTMENT COMM		9,603	1,808,148.87	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		20,987	687,114.38	
PROLOGIS INC		63,163	8,410,153.45	
PUBLIC STORAGE		13,171	4,247,252.37	
REALTY INCOME CORP		31,608	2,261,236.32	
REGENCY CENTERS CORP		12,511	805,708.40	
SBA COMMUNICATIONS CORP		9,113	3,279,404.18	
SIMON PROPERTY GROUP		28,176	3,619,488.96	
SUN COMMUNITIES INC		9,065	1,790,246.85	
UDR INC		24,265	1,286,045.00	
VENTAS INC		31,565	1,722,502.05	
VEREIT INC		21,159	1,055,834.10	
VICI PROPERTIES INC		43,921	1,285,567.67	
VORNADO REALTY TRUST		15,390	628,989.30	
WELLTOWER INC		35,679	2,999,890.32	
WP CAREY INC		14,258	1,099,862.12	
アメリカドル 小計		1,019,402	89,991,667.83	(9,889,184,377)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	528,776.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	335,978.10	
カナダドル 小計		24,377	864,754.60	(74,144,059)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	391,601.04	
	GECINA SA	4,459	590,817.50	
	KLEPIERRE	17,225	350,012.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	766,769.70	
ユーロ 小計		37,101	2,099,200.24	(269,495,326)

イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	408,664.44	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	471,077.90	
	SEGRO PLC	106,999	1,366,377.23	
イギリスポンド 小計		252,762	2,246,119.57	(336,693,323)
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	995,472.20	
	GOODMAN GROUP	139,848	3,150,775.44	
	GPT GROUP	167,884	792,412.48	
	MIRVAC GROUP	266,683	818,716.81	
	SCENTRE GROUP	486,663	1,240,990.65	
	STOCKLAND	207,412	943,724.60	
	VICINITY CENTERS	365,149	573,283.93	
オーストラリアドル 小計		1,727,729	8,515,376.11	(669,308,562)
香港ドル	LINK REIT	170,500	12,429,450.00	
香港ドル 小計		170,500	12,429,450.00	(175,379,539)
シンガポ ールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	877,986.42	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	426,560	891,510.40	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	455,400.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	565,285.95	
シンガポールドル 小計		1,203,783	2,790,182.77	(224,832,927)
投資証券合計		4,435,654	11,639,038,113	(11,639,038,113)
合計			11,942,398,963	(11,942,398,963)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 598銘柄	97.3%			70.8%
	投資証券 36銘柄			2.7%	1.9%
カナダドル	株式 89銘柄	99.6%			3.4%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%

ユーロ	株式	231銘柄	99.5%			10.4%
	投資証券	4銘柄			0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式	83銘柄	98.5%			4.4%
	投資証券	3銘柄			1.5%	0.1%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.0%			3.2%
スウェーデンクローナ	株式	41銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%			0.9%
オーストラリアドル	株式	54銘柄	91.8%			2.0%
	投資信託受益証券	3銘柄		2.0%		0.0%
	投資証券	7銘柄			6.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	30銘柄	94.6%			0.9%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.7%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	86.7%			0.3%
	投資証券	4銘柄			13.3%	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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	442,742,146
コール・ローン	4,212,348,033
国債証券	289,976,579,382
派生商品評価勘定	12,377,386
未収利息	1,398,019,441
前払費用	37,962,856
差入委託証拠金	508,168,187

	2021年 8月20日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	296,588,197,431
資産合計	296,588,197,431
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,024,247
前受金	6,859,423
未払解約金	64,441,290
未払利息	7,554
流動負債合計	102,332,514
負債合計	102,332,514
純資産の部	
元本等	
元本	96,318,492,637
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	200,167,372,280
元本等合計	296,485,864,917
純資産合計	296,485,864,917
負債純資産合計	296,588,197,431

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 8月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2021年 8月20日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	96,318,492,637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 3.0782円 (1万口当たり純資産額) (30,782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

2021年 8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。

	2021年 8月20日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8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ぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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つた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(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	2021年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月21日
期首元本額	96,830,254,121円
期中追加設定元本額	17,613,844,189円
期中一部解約元本額	18,125,605,673円
期末元本額	96,318,492,637円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,409,148,541円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	604,651,717円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,085,622,540円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,694,556円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	7,405,466,028円
世界経済インデックスファンド	10,425,917,598円
D C マイセレクション 2 5	1,912,432,162円
D C マイセレクション 5 0	1,612,615,160円
D C マイセレクション 7 5	1,099,241,189円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,206,191,727円
D C マイセレクション S 2 5	899,823,637円
D C マイセレクション S 5 0	696,020,876円
D C マイセレクション S 7 5	370,251,536円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	38,660,249円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	85,966,351円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	42,871,289円
D C 世界経済インデックスファンド	11,490,826,353円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	637,414,368円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	4,005,812円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,235,701円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,233,869円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	32,024,673円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	64,182,615円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	106,609,424円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	88,244,203円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	89,486,519円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,534,045,548円

区分	2021年 8月20日現在
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	473,858,158円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,877,592,603円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	242,491,166円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	61,754,529円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	494,779,705円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	185,399,657円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	228,168,402円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	777,788,384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）	2,056,078,721円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	742,940,466円
外国債券ファンド・シリーズ1	628,190,618円
コア投資戦略ファンド（安定型）	911,972,296円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,396,565,810円
分散投資コア戦略ファンドA	256,969,288円
分散投資コア戦略ファンドS	551,227,295円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	473,244,932円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,713,302,195円
コア投資戦略ファンド（切替型）	934,327,768円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	233,041,240円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,193,388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）	1,295,067,443円
SMT インデックスバランス・オープン	195,004,273円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	18,082,966,761円
SMT 世界経済インデックス・オープン	192,668,692円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	217,480,550円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	352,296,985円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,628,791円
グローバル経済コア	766,604,113円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,688,263円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,286,023円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	271,449,363円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	32,680,097円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	4,732,366円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	4,035,516円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2,064,002円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2,026,517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）	509,243,682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）	10,598,379,661円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	337,223,506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）	344,340,343円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	214,220,731円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	185,883,196円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	43,657円

区分	2021年 8月20日現在
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	20,374円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 8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		5,977,810,349
合計		5,977,810,349

(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

（2021年 8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	4,443,510,788	-	4,450,370,211	6,859,423
	合計	4,443,510,788	-	4,450,370,211	6,859,423

(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

（2021年 8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		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	4,222,236,240	-	4,196,729,956	25,506,284
	アメリカドル	1,945,537,430	-	1,942,423,808	3,113,622
	カナダドル	187,038,873	-	182,574,228	4,464,645
	ユーロ	1,784,623,211	-	1,771,980,720	12,642,491
	イギリスポンド	305,036,726	-	299,751,200	5,285,526
	合計	4,222,236,240	-	4,196,729,956	25,506,284

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,954,687.50	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,687,553.92	
		T 0.125% 04/30/23	5,000,000.00	4,994,433.60	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,491,943.35	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,039,850.00	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,976,250.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,237,177.74	
		T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,398,875.00	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,970,039.03	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,161,101.56	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,963,671.90	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,005,937.52	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	986,406.25	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,855,078.10	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,378,125.00	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,537,984.38	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,883,437.52	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	7,001,640.66	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,942,187.52	
		T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,213,886.69	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,739,687.52	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,961,914.07	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,945,312.52	
T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	11,391,289.12			

T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,810,822.88	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,206,462.50	
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,880,855.46	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,425,488.29	
T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,943,855.45	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,547,322.64	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,302,246.07	
T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,462,195.38	
T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	15,188,636.79	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,450,781.25	
T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,792,578.10	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,381,464.86	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	11,012,031.25	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	3,002,226.57	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	8,044,687.52	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,837,277.39	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	14,935,949.29	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	8,076,250.00	
T 1.125% 05/15/40	6,260,000.00	5,635,956.25	
T 1.125% 08/15/40	9,300,000.00	8,342,390.62	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,236,503.93	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	8,131,250.00	
T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	7,424,132.81	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,641,533.21	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	4,116,562.52	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,108,691.40	
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,763,820.36	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,557,617.20	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,094,531.24	
T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,073,046.90	
T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	12,162,109.44	
T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,318,308.58	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,215,390.64	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,655,001.56	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,960,265.66	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,085,781.24	
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,140,820.30	
T 1.5% 08/15/26	2,400,000.00	2,485,031.25	
T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,643,984.37	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,777,246.11	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,428,113.26	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,585,449.21	

T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,363,371.47
T 1.625% 05/15/31	9,470,000.00	9,819,946.14
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,025,468.75
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,538,232.42
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	7,017,363.31
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,079,687.50
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,574,121.10
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,608,253.88
T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,230,710.90
T 1.625% 11/15/50	11,300,000.00	10,640,539.11
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,150,749.19
T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,671,085.92
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,724,741.20
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,790,321.87
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,492,343.74
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,244,953.12
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,150,000.00
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	8,040,101.60
T 1.875% 02/15/51	9,900,000.00	9,889,945.36
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,153,984.42
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,470,381.65
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,074,062.52
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,259,921.86
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,712,836.32
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,607,439.43
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,330,894.54
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,741,960.95
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,537,437.51
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,833,578.11
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,040,375.02
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	5,258,789.05
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,791,910.93
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,463,806.25
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,188,593.76
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,630,339.88
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	8,021,191.42
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,353,281.25
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,225,316.44
T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	7,864,657.06
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	5,957,617.21
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,656,343.75
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,729,263.64
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,692,359.36

T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,261,701.19
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,706,718.75
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,889,890.60
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,160,937.50
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,056,324.98
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,797,335.94
T 2.375% 05/15/27	5,840,000.00	6,335,487.50
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,770,950.00
T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	3,071,191.42
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,290,429.70
T 2.375% 11/15/49	6,100,000.00	6,786,250.00
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,654,750.39
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,338,281.25
T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,613,507.04
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,514,687.52
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,201,637.71
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,358,261.69
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,703,343.75
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,754,750.00
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,086,268.37
T 2.625% 02/15/29	7,490,000.00	8,326,773.43
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,452,718.75
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,787,802.75
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,119,638.67
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,691,269.54
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,306,288.29
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,180,820.32
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,286,619.15
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,756,445.30
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,056,039.82
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,951,171.87
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,049,101.56
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,519,578.12
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	5,870,390.62
T 2.75% 08/31/23	1,500,000.00	1,576,230.46
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,482,457.01
T 2.75% 11/15/23	2,320,000.00	2,447,781.26
T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,296,756.25
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,619,492.18
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,337,187.52
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,152,753.12
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,950,820.31

T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,802,362.50
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,146,341.41
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,940,949.23
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	4,410,612.50
T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,167,390.62
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,011,806.65
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,642,480.47
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,256,489.08
T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,197,558.57
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,137,500.00
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,889,278.92
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,139,453.15
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,503,535.93
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,457,527.72
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,750,292.95
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,054,843.75
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,264,912.87
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,225,585.90
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,847,571.87
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,048,085.94
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,299,046.87
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	2,477,500.00
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,532,953.12
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	5,157,210.95
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,618,000.00
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,160,976.56
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,892,071.10
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	7,045,687.50
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	995,465.62
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,214,125.00
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,666,875.00
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,687,500.00
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	4,079,531.25
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,970,414.06
T 3% 02/15/47	800,000.00	989,250.00
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,524,257.81
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,736,875.00
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,966,275.00
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,289,140.62
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	7,070,585.93
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,779,289.06
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,601,460.94
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,486,132.80

	T 3% 11/15/44	2,800,000.00	3,422,343.76
	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,271,531.25
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,348,015.62
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,418,750.00
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,740,304.69
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,828,718.75
	T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,809,576.56
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,536,644.53
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	792,128.90
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,473,367.19
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	2,043,585.94
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,135,957.03
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,648,109.37
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,684,312.50
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,690,238.29
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,565,718.75
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,099,964.84
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,909,128.91
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,498,464.84
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,847,387.70
	アメリカドル 小計	1,142,350,000.00	1,199,721,714.37 (131,837,419,192)
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,056,940.00
	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,223,661.20
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,381,016.00
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,594,202.00
	CAN 0.25% 08/01/22	910,000.00	909,954.50
	CAN 0.25% 08/01/23	1,360,000.00	1,354,886.40
	CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,769,398.20
	CAN 0.5% 09/01/25	2,480,000.00	2,456,489.60
	CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,286,900.00
	CAN 1.25% 03/01/25	1,960,000.00	1,999,670.40
	CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,706,491.80
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,091,111.10
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,404,050.40
	CAN 1.5% 06/01/31	2,220,000.00	2,286,355.80
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	615,990.00
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,698,445.40
	CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,742,404.10
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,519,300.00
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,399,176.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,905,408.00

	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,379,926.80
	CAN 2.5% 06/01/24	300,000.00	315,912.00
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,317,870.80
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	720,972.00
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,402,001.30
	CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,444,342.70
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	5,028,678.60
	CAN 3.5% 12/01/45	1,150,000.00	1,575,776.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,488,427.50
	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,585,665.90
	CAN 5.75% 06/01/33	960,000.00	1,424,707.20
	CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,234,337.80
	カナダドル 小計	63,540,000.00	67,320,469.50 (5,772,057,054)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,592,338.50
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	33,961,328.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	38,440,000.00	37,206,076.00
	MBONO 6.75% 03/09/23	29,950,000.00	30,460,647.50
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	40,269,904.50
	MBONO 7.75% 05/29/31	27,580,000.00	28,959,827.40
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	24,547,528.20
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,600,000.00	11,067,778.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	33,970,000.00	37,088,785.70
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,220,000.00	28,574,556.00
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	36,197,291.70
	MBONO 8% 11/07/47	24,630,000.00	25,520,620.80
	MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	36,434,965.60
		メキシコペソ 小計	362,940,000.00
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,420,977.70
	BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	1,000,344.80
	BGB 0.4% 06/22/40	1,050,000.00	1,062,180.00
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,684,200.60
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	598,496.00
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,836,967.60
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,827,887.10
	BGB 0.8% 06/22/28	2,090,000.00	2,277,953.70
	BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,603,103.60
	BGB 0% 10/22/27	430,000.00	444,564.10
	BGB 0% 10/22/31	1,020,000.00	1,037,125.80
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,740,225.00
	BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	864,532.80
	BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,734,908.40

BGB 1.7% 06/22/50	1,140,000.00	1,475,251.20
BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,343,023.50
BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,463,927.60
BGB 1% 06/22/31	1,980,000.00	2,221,718.40
BGB 2.15% 06/22/66	770,000.00	1,179,270.40
BGB 2.25% 06/22/23	1,010,000.00	1,065,802.50
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,156,509.20
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,345,589.80
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,096,448.00
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,429,866.60
BGB 4.25% 03/28/41	1,870,000.00	3,264,664.70
BGB 4.25% 09/28/22	1,820,000.00	1,920,227.40
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,417,533.00
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,566,550.80
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,920,606.20
BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,524,768.30
BKO 0% 03/10/23	1,210,000.00	1,224,326.40
BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	4,999,401.00
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,046,463.30
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,691,071.20
BTPS 0.3% 08/15/23	1,850,000.00	1,877,287.50
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	592,603.40
BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,814,955.90
BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	2,327,788.80
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,132,266.60
BTPS 0.6% 08/01/31	1,850,000.00	1,856,993.00
BTPS 0.65% 10/15/23	670,000.00	686,019.70
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,353,995.00
BTPS 0.9% 04/01/31	3,800,000.00	3,939,878.00
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,222,866.40
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,044,580.00
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	1,007,668.20
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,638,643.40
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,330,060.10
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,505,259.40
BTPS 0.95% 12/01/31	1,700,000.00	1,758,310.00
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,009,190.00
BTPS 0% 04/15/24	2,000,000.00	2,018,200.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,083,107.00
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,099,409.80
BTPS 1.45% 03/01/36	1,450,000.00	1,549,267.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,445,820.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,032,287.50

BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,536,536.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,568,867.20	
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,061,748.70	
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,329,902.80	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,811,703.80	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,120,000.00	1,159,132.80	
BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,392,224.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,975,977.00	
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,121,720.00	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,915,244.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,064,964.00	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,543,712.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	764,748.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,566,846.80	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,168,292.80	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,152,424.00	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	2,194,860.30	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	3,088,150.20	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,286,831.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,221,783.50	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,210,000.00	2,788,953.70	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,020,000.00	1,279,243.20	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,242,409.40	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,631,913.00	
BTPS 2% 02/01/28	2,690,000.00	3,015,328.60	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,285,958.40	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,867,257.40	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,687,197.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,915,082.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	3,032,384.40	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	5,005,796.40	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,416,686.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,860,000.00	2,850,505.80	
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	4,073,932.80	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,091,275.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,520,689.60	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,885,230.80	
BTPS 4.75% 08/01/23	3,650,000.00	4,023,249.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,779,657.30	
BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	5,089,016.50	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	5,049,094.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	4,871,160.00	

BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,988,984.00
BTPS 5.5% 09/01/22	1,400,000.00	1,486,506.00
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,697,468.50
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	3,551,943.60
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,345,152.00
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,489,155.00
BTPS 5% 09/01/40	2,880,000.00	4,736,707.20
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	5,022,252.00
BTPS 6% 05/01/31	2,940,000.00	4,478,619.60
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,934,296.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	965,848.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,108,151.20
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,164,128.30
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,327,128.20
DBR 0.5% 02/15/25	1,350,000.00	1,412,721.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,177,450.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,582,562.30
DBR 0.5% 08/15/27	4,040,000.00	4,344,939.20
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,758,781.60
DBR 0% 02/15/31	800,000.00	841,576.00
DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,947,323.00
DBR 0% 05/15/36	1,670,000.00	1,735,814.70
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,520,346.00
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,681,930.00
DBR 0% 08/15/30	6,450,000.00	6,791,076.00
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	709,804.70
DBR 0% 08/15/31	750,000.00	787,755.00
DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	4,488,200.60
DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,258,388.00
DBR 0% 11/15/28	900,000.00	943,947.00
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,893,860.00
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,061,409.60
DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,139,924.20
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,436,102.00
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,865,968.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,756,227.00
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,109,520.00
DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,918,886.40
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,780,218.20
DBR 2.5% 08/15/46	3,570,000.00	5,978,893.20
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,020,160.00
DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	3,902,120.90
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,950,117.80

DBR 4.25% 07/04/39	2,310,000.00	4,250,376.90
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,536,289.00
DBR 4.75% 07/04/34	2,990,000.00	5,064,043.40
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,604,135.80
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,523,353.20
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,344,993.20
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,775,773.10
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,998,037.50
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,409,877.00
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,887,792.00
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,838,810.90
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,365,063.60
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,716,047.00
FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,219,896.50
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	866,250.00
FRTR 0.5% 06/25/44	1,230,000.00	1,251,414.30
FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	6,814,145.70
FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	3,937,674.00
FRTR 0.75% 05/25/53	770,000.00	791,128.80
FRTR 0.75% 11/25/28	5,100,000.00	5,539,722.00
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,072,673.00
FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,561,915.00
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,357,390.90
FRTR 0% 02/25/27	950,000.00	978,167.50
FRTR 0% 03/25/23	7,190,000.00	7,273,260.20
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,060,789.00
FRTR 0% 03/25/25	5,490,000.00	5,624,614.80
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,402,177.80
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,172,638.40
FRTR 0% 11/25/31	2,910,000.00	2,953,795.50
FRTR 1.25% 05/25/34	4,110,000.00	4,752,393.00
FRTR 1.25% 05/25/36	5,930,000.00	6,903,646.70
FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,885,233.30
FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	4,479,709.70
FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,615,267.40
FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,252,301.40
FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,852,278.60
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,496,460.80
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,069,476.50
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,657,414.40
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,440,136.00
FRTR 2.25% 10/25/22	2,940,000.00	3,042,753.00

FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,974,936.20
FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,203,222.90
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,885,174.40
FRTR 3.25% 05/25/45	3,050,000.00	5,006,819.00
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,596,886.00
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,568,987.20
FRTR 4.5% 04/25/41	4,520,000.00	8,164,566.40
FRTR 4.75% 04/25/35	3,130,000.00	5,159,241.60
FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	4,899,895.00
FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	4,320,794.10
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,550,457.40
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,559,418.90
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,227,792.60
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,437,757.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,155,620.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	968,743.80
IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,069,304.80
IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	792,208.80
IRISH 0.55% 04/22/41	390,000.00	404,199.90
IRISH 0.9% 05/15/28	720,000.00	785,635.20
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	533,964.40
IRISH 0% 10/18/31	880,000.00	889,970.40
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,335,720.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	775,364.20
IRISH 1.35% 03/18/31	620,000.00	713,632.40
IRISH 1.5% 05/15/50	780,000.00	968,533.80
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	1,014,217.00
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,529,070.20
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,498,113.10
IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,559,112.50
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,072,529.00
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,083,719.90
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,839,300.80
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,402,007.30
NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,813,985.10
NETHER 0.5% 01/15/40	1,440,000.00	1,602,950.40
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,461,218.40
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,288,674.80
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,772,118.00
NETHER 0% 01/15/24	1,420,000.00	1,447,264.00
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,906,332.00
NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	711,627.00
NETHER 0% 01/15/52	980,000.00	965,270.60

NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,996,089.60	
NETHER 0% 07/15/31	860,000.00	891,218.00	
NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,034,439.20	
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,682,822.60	
NETHER 2.75% 01/15/47	2,230,000.00	3,828,999.20	
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,153,060.60	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,560,000.00	1,659,574.80	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	4,039,492.50	
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,610,908.40	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,420,754.40	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	223,330.00	
OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,400,762.50	
OBL 0% 04/10/26	4,070,000.00	4,220,142.30	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,860,812.50	
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,248,549.20	
OBL 0% 10/07/22	3,110,000.00	3,136,435.00	
OBL 0% 10/10/25	4,340,000.00	4,486,084.40	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,536,183.40	
OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,580,111.80	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,894,891.20	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	947,271.50	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,757,262.60	
RAGB 0.75% 03/20/51	680,000.00	760,212.80	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,231,860.80	
RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	353,654.40	
RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,493,558.00	
RAGB 0% 02/20/31	740,000.00	758,514.80	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	953,780.10	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,521,615.00	
RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,471,435.20	
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	322,515.20	
RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	405,484.80	
RAGB 1.2% 10/20/25	700,000.00	756,826.00	
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,215,621.60	
RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	486,773.10	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,066,586.40	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,403,203.20	
RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	1,512,367.20	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,080,000.00	1,426,172.40	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,384,921.40	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,482,861.60	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	1,056,959.50	

RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	3,000,324.60
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,648,517.10
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,668,661.60
RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	551,280.60
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	443,596.40
RFGB 0.125% 09/15/31	400,000.00	415,196.00
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	411,848.00
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	654,571.20
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	928,533.60
RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	696,371.00
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	817,456.00
RFGB 0.75% 04/15/31	620,000.00	684,821.00
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	734,815.50
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	548,532.00
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	429,571.80
RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	649,208.70
RFGB 1.125% 04/15/34	560,000.00	649,544.00
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	641,944.10
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	674,583.00
RFGB 1.625% 09/15/22	850,000.00	871,479.50
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	905,720.80
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	517,498.80
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	784,268.20
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	984,919.50
SPGB 0.1% 04/30/31	2,180,000.00	2,169,993.80
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,344,822.60
SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,657,492.00
SPGB 0.45% 10/31/22	2,460,000.00	2,492,791.80
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	3,022,206.00
SPGB 0.5% 10/31/31	930,000.00	956,449.20
SPGB 0.6% 10/31/29	2,950,000.00	3,105,848.50
SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,130,200.00
SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	986,908.80
SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,393,522.00
SPGB 0% 01/31/26	1,410,000.00	1,437,241.20
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,957,232.30
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,405,204.20
SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,279,164.60
SPGB 1.2% 10/31/40	2,260,000.00	2,414,900.40
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,378,149.50
SPGB 1.3% 10/31/26	2,750,000.00	2,996,812.50
SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,759,667.00
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,666,630.00

SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	3,013,445.60	
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,367,073.60	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	635,309.40	
SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,932,225.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,292,627.50	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,255,257.50	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,127,614.30	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,443,151.60	
SPGB 1% 10/31/50	2,330,000.00	2,271,260.70	
SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,125,731.60	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	3,019,378.00	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,584,616.50	
SPGB 2.75% 10/31/24	2,500,000.00	2,767,425.00	
SPGB 2.9% 10/31/46	2,050,000.00	2,938,121.50	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	2,925,109.60	
SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,819,602.80	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,909,836.70	
SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,988,455.50	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,426,005.60	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,555,900.80	
SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,719,608.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,250,000.00	3,931,290.00	
SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,944,138.20	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,810,000.00	3,434,384.50	
SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,283,981.00	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	4,576,371.80	
SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,580,341.20	
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,534,900.50	
ユーロ 小計	770,860,000.00	915,734,451.00 (117,561,988,819)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,520,000.00	1,510,971.20
	UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,510,811.80
	UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,965,693.50
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,221,828.60
	UKT 0.25% 01/31/25	650,000.00	650,611.00
	UKT 0.25% 07/31/31	2,110,000.00	2,033,196.00
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,379,876.40
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,192,064.00
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,727,914.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,950,000.00	2,872,061.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,860,000.00	1,711,014.00
	UKT 0.75% 07/22/23	2,360,000.00	2,389,382.00

UKT 0.875% 01/31/46	960,000.00	939,360.00	
UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,753,023.00	
UKT 1.125% 01/31/39	500,000.00	516,145.00	
UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,150,921.80	
UKT 1.25% 07/31/51	180,000.00	193,896.00	
UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,960,496.00	
UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,122,000.00	
UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	2,669,022.90	
UKT 1.625% 10/22/28	1,620,000.00	1,760,891.40	
UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,234,994.60	
UKT 1.625% 10/22/71	1,120,000.00	1,531,734.40	
UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,553,006.00	
UKT 1.75% 07/22/57	2,210,000.00	2,803,981.70	
UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,174,974.40	
UKT 1.75% 09/07/37	2,930,000.00	3,317,609.70	
UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,636,320.00	
UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,609,400.00	
UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	3,104,928.00	
UKT 2.75% 09/07/24	1,120,000.00	1,207,830.40	
UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,908,996.60	
UKT 3.25% 01/22/44	2,580,000.00	3,779,390.40	
UKT 3.5% 01/22/45	2,550,000.00	3,917,386.50	
UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,958,314.20	
UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,815,392.00	
UKT 4.25% 03/07/36	2,090,000.00	3,083,356.10	
UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,890,335.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	2,532,853.80	
UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,702,910.00	
UKT 4.25% 12/07/40	1,900,000.00	3,026,434.00	
UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,795,401.80	
UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,756,625.80	
UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	3,805,675.00	
UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,597,634.30	
UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,959,280.00	
UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	2,017,136.00	
UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,685,243.00	
UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	3,132,036.60	
UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,106,486.00	
UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,750,775.00	
イギリスポンド 小計	98,380,000.00	123,627,620.90 (18,531,780,372)	
スウェーデン ンクローナ			
SGB 0.125% 05/12/31	5,970,000.00	6,004,745.40	
SGB 0.75% 05/12/28	7,380,000.00	7,793,427.60	

	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,890,585.70
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,008,500.00
	SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,566,187.30
	SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,608,637.50
	SGB 2.5% 05/12/25	9,300,000.00	10,264,131.00
	SGB 3.5% 03/30/39	5,580,000.00	8,531,038.80
スウェーデンクローナ 小計		60,920,000.00	67,667,253.30 (844,487,321)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	3,028,980.00
	NGB 1.375% 08/19/30	5,040,000.00	5,136,717.60
	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,868,116.80
	NGB 1.75% 02/17/27	6,060,000.00	6,288,643.80
	NGB 1.75% 03/13/25	4,770,000.00	4,907,853.00
	NGB 1.75% 09/06/29	7,640,000.00	8,001,830.40
	NGB 2% 04/26/28	4,510,000.00	4,774,511.50
	NGB 2% 05/24/23	10,660,000.00	10,925,220.80
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,768,406.40
ノルウェークローネ 小計		54,780,000.00	56,700,280.30 (689,475,408)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/22	7,170,000.00	7,245,213.30
	DGB 0.25% 11/15/52	3,870,000.00	3,931,029.90
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	11,047,284.00
	DGB 0.5% 11/15/29	14,260,000.00	15,272,460.00
	DGB 0% 11/15/24	1,830,000.00	1,865,465.40
	DGB 0% 11/15/31	3,110,000.00	3,169,090.00
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,772,375.80
	DGB 1.75% 11/15/25	7,280,000.00	8,002,976.80
	DGB 4.5% 11/15/39	14,980,000.00	27,368,010.60
デンマーククローネ 小計		70,340,000.00	85,673,905.80 (1,478,731,614)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,900,000.00	1,811,688.00
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,567,084.40
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,222,460.10
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	4,046,499.00
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,132,512.90
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,047,637.20
	POLGB 2.5% 04/25/24	1,800,000.00	1,894,572.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,483,109.20
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	4,060,816.20
	POLGB 2.75% 04/25/28	5,380,000.00	5,900,891.60
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,220,000.00	6,855,497.40
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,910,000.00	5,367,121.00

	POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	4,055,423.20	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	792,246.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,410,000.00	3,621,249.50	
	ポージングズロチ 小計	56,550,000.00	59,858,807.70 (1,677,106,116)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,935,918.60	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,325,351.60	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,040,000.00	2,036,858.40	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,780,908.20	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,329,307.30	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,760,000.00	1,682,560.00	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,610,000.00	1,714,762.70	
	ACGB 1% 11/21/31	3,250,000.00	3,228,452.50	
	ACGB 1% 12/21/30	4,320,000.00	4,319,913.60	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,816,179.20	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,248,543.20	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,289,408.30	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,480,174.20	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,901,101.60	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,450,637.40	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	2,175,110.00	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,891,271.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	2,420,000.00	2,779,999.20	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,855,944.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,597,650.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,224,363.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,134,350.00	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	2,054,757.60	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,820,000.00	3,314,684.40	
ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,613,109.20		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,857,706.40		
ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,727,650.00		
	オーストラリアドル 小計	63,450,000.00	69,766,672.20 (5,483,660,434)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	390,000.00	387,117.90	
	SIGB 1.625% 07/01/31	300,000.00	306,912.00	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	816,056.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	420,000.00	425,598.60	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	786,301.80	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	959,037.30	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	522,756.50	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	471,735.80	
	SIGB 2.625% 05/01/28	530,000.00	583,132.50	

	SIGB 2.75% 03/01/46	1,190,000.00	1,390,360.30	
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,039,077.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,117,326.10	
	SIGB 2.875% 07/01/29	590,000.00	663,744.10	
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	859,757.60	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	425,846.50	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,350,000.00	1,388,880.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	995,327.70	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,000,850.40	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,711,794.00	
	シンガポールドル 小計	14,560,000.00	15,851,612.10 (1,277,322,903)	
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,524,330.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	722,148.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,387,900.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,557,112.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	2,630,000.00	2,739,934.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,122,754.50	
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	525,910.00	
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,532,730.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	962,708.10	
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,374,557.50	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,077,658.10	
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,571,610.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,188,262.80	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,079,492.60	
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,527,854.40	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	633,348.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,507,353.80	
	MGS 4.059% 09/30/24	960,000.00	1,008,489.60	
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	735,322.80	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,345,497.60	
	MGS 4.232% 06/30/31	3,000,000.00	3,222,690.00	
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,123,481.50	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,127,202.40	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	3,113,939.40	
	MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,068,569.00	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,553,452.40	
MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,488,300.80		
MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,538,851.70		
MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,807,747.20		
MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,114,367.30		

マレーシアリングット 小計		50,550,000.00	53,283,576.00 (1,381,733,707)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	701,234.59	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	860,000.00	867,095.60	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,445,811.22	
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,490,000.00	6,535,874.56	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,118,761.92	
	ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,806,948.14	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,147,583.59	
	ILGOV 1% 03/31/30	3,180,000.00	3,190,365.52	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,360,000.00	2,611,522.65	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,468,256.88	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	4,092,196.43	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,410,000.00	3,891,938.64	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	4,940,000.00	6,438,092.54	
イスラエルシェケル 小計		35,590,000.00	40,315,682.28 (1,363,754,552)	
合計			289,976,579,382 (289,976,579,382)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 214銘柄	100.0%	45.5%
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 13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 340銘柄	100.0%	40.5%
イギリスポンド	国債証券 51銘柄	100.0%	6.4%
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 9銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 30銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2021年 8月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,732,090,192
コール・ローン	66,909,224
株式	89,391,000,085
投資信託受益証券	236,736,155
投資証券	88,774,353
派生商品評価勘定	19,417
未収入金	397,856,413
未収配当金	260,348,173
前払金	289,631,030
差入委託証拠金	952,256,812
流動資産合計	94,415,621,854
資産合計	94,415,621,854
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	289,692,815
未払解約金	3,468,314
未払利息	119
流動負債合計	293,161,248
負債合計	293,161,248
純資産の部	
元本等	
元本	27,055,872,743
剰余金	
剰余金又は欠損金()	67,066,587,863
元本等合計	94,122,460,606
純資産合計	94,122,460,606
負債純資産合計	94,415,621,854

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2021年 8月20日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	2021年 8月20日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2021年 8月20日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	27,055,872,743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 3.4788円 (1万口当たり純資産額) (34,788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

	2021年 8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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2021年 8月20日現在
期首	2020年 8月21日
期首元本額	25,720,936,520円
期中追加設定元本額	4,361,078,210円
期中一部解約元本額	3,026,141,987円
期末元本額	27,055,872,743円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,623,707,327円
世界経済インデックスファンド	4,394,251,283円
D C 新興国株式インデックス・オープン	5,070,479,333円
D C 世界経済インデックスファンド	4,835,716,155円
新興国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	198,728,849円
分散投資コア戦略ファンドA	221,285,842円
分散投資コア戦略ファンドS	1,278,519,624円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	637,043,147円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	558,172,805円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	318,850,098円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	15,652,733円
S M T インデックスバランス・オープン	83,419,585円
S M T 世界経済インデックス・オープン	122,711,598円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	430,983,059円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	76,611,542円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,196,594円
グローバル経済コア	348,986,054円
i - S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	32,525,333円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	6,541,394円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	4,863,898円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2,235,698円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2,025,684円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	685,922,789円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,412,409円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	27,315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）	2,595円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,006,180,406
投資信託受益証券	38,456,355
投資証券	13,818,362

合計	3,058,455,123
----	---------------

(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

(2021年 8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	株価指数先物取引 買建	4,753,397,994	-	4,463,766,964	289,631,030
合計		4,753,397,994	-	4,463,766,964	289,631,030

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2021年 8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		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	125,313,200	-	125,270,832	42,368
	アメリカドル	125,313,200	-	125,270,832	42,368
合計		125,313,200	-	125,270,832	42,368

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	GAZPROM OAO-SPON ADR	631,765	7.81	4,937,875.24	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	41,579	84.90	3,530,057.10	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,590	236.00	2,499,240.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	134,073	7.10	952,454.59	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	123,206	4.54	560,340.88	
	TATNEFT-SPONSORED ADR	25,084	39.37	987,557.08	
	YPF S.A. -SPONSORED ADR	15,511	4.40	68,248.40	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	6.44	109,029.20	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	72,204	31.69	2,288,144.76	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	19,598	32.26	632,231.48	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	26,818	18.61	499,082.98	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,938	91.45	725,930.10	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	22.52	873,167.96	
	SOUTHERN COPPER CORP	9,585	60.87	583,438.95	
	51JOB INC-ADR	2,701	71.96	194,363.96	
	DIDI GLOBAL INC	34,321	7.20	247,111.20	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	44,721	25.58	1,143,963.18	
	LI AUTO INC - ADR	53,640	27.54	1,477,245.60	
	NIO INC - ADR	137,294	36.29	4,982,399.26	
	XPENG INC - ADR	40,797	37.57	1,532,743.29	
	GAOTU TECHEDU INC	16,359	2.38	38,934.42	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	19,163	43.51	833,782.13	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	156,180	1.81	282,685.80	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	5.07	208,164.06	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	45,333	58.96	2,672,833.68	
	AUTOHOME INC-ADR	6,571	37.26	244,835.46	
	BAIDU INC - SPON ADR	28,591	137.33	3,926,402.03	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	18,268	64.33	1,175,180.44	
	DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	5,000	3.23	16,150.00	
	HELLO GROUP INC -SPN ADR	15,529	11.19	173,769.51	
	HUYA INC-ADR	8,211	9.55	78,415.05	
	IQIYI INC-ADR	28,984	8.20	237,668.80	
	JOYY INC	6,185	45.28	280,056.80	
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	19,368	19.91	385,616.88		
NETEASE INC-ADR	42,826	78.92	3,379,827.92		
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	64,895	7.23	469,190.85		
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	47.60	249,852.40		
YANDEX NV-A	30,372	68.25	2,072,889.00		
BAOZUN INC-SPN ADR	3,508	19.15	67,178.20		
DADA NEXUS LTD-ADR	7,696	17.89	137,681.44		

	JD.COM INC-ADR	91,706	62.19	5,703,196.14
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	3,921	50.03	196,167.63
	PINDUODUO INC-ADR	46,519	74.69	3,474,504.11
	TRIP.COM GROUP LTD	55,661	26.53	1,476,686.33
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	13.15	693,859.75
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	39,926	15.09	602,682.97
	ADECOAGRO SA	17,629	8.76	154,430.04
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	8,157	4.23	34,504.11
	BEIGENE LTD-ADR	4,929	275.44	1,357,643.76
	BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	5,009	18.87	94,519.83
	HUTCHMED CHINA-ADR	7,243	38.36	277,841.48
	I-MAB-SPONSORED ADR	2,944	57.18	168,337.92
	ZAI LAB LTD-ADR	7,677	130.00	998,010.00
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	141,961	3.75	532,353.75
	CREDICORP LTD	7,637	92.30	704,895.10
	SBERBANK-SPONSORED ADR	268,967	17.69	4,758,026.23
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	11,906	93.14	1,108,924.84
	VTB BANK PJSC -GDR-REG S	378,037	1.30	494,472.39
	360 DIGITECH INC	8,061	16.90	136,230.90
	LUFAX HOLDING LTD	12,385	8.63	106,882.55
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2,021	36.35	73,463.35
	UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	10,604	12.92	137,003.68
	KE HOLDINGS INC	35,590	17.01	605,385.90
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,432	0.97	52,853.47
	21VIANET GROUP INC-ADR	7,475	15.99	119,525.25
	AGORA INC-ADR	4,630	25.94	120,102.20
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	12,493	9.92	123,930.56
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	9,050	50.30	455,215.00
	GLOBANT SA	3,899	288.67	1,125,524.33
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	5,558	24.10	133,947.80
	ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	10,976	4.09	44,891.84
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	39,854	8.69	346,331.26
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,948	45.92	227,212.16
	アメリカドル 小計	3,431,044		72,395,296.71 (7,955,519,155)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	1,545,161	15.54	24,011,801.94
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	323,292	86.41	27,935,661.72
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	270.84	3,927,180.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	96,852	54.37	5,265,843.24
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	64.33	2,412,375.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	341.35	7,955,161.75
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	218.18	9,530,102.40

	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,980	149.38	2,536,472.40	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	288,490	49.74	14,349,492.60	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	31,400	70.83	2,224,062.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	567,680	71.57	40,628,857.60	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	124.27	6,272,528.25	
	BECLE SAB DE CV	48,100	45.56	2,191,436.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	207,440	173.45	35,980,468.00	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	224.92	5,838,923.20	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	49.81	9,055,458.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	33.85	6,153,930.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	282,600	126.59	35,774,334.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	19.43	4,906,075.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,658,740	18.16	66,442,718.40	
	TELESITES SAB DE CV	74,800	15.82	1,183,336.00	
	メキシコペソ 小計	7,953,055		314,576,217.50 (1,715,478,486)	
ブラジルリアル	COSAN SA	118,300	22.44	2,654,652.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	375,100	27.16	10,187,716.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	544,440	26.64	14,503,881.60	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	15.37	1,161,972.00	
	BRADSPAR SA -PREF	24,000	63.41	1,521,840.00	
	BRASKEM SA-PREF A	19,300	57.46	1,108,978.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	63,000	37.00	2,331,000.00	
	GERDAU SA-PREF	105,000	27.69	2,907,450.00	
	SUZANO SA	74,079	55.68	4,124,718.72	
	VALE SA	420,578	97.51	41,010,560.78	
	WEG SA	171,144	35.19	6,022,557.36	
	CCR SA	125,600	12.27	1,541,112.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,952	58.14	3,601,889.28	
	RUMO SA	159,700	18.26	2,916,122.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	28,600	57.90	1,655,940.00	
	AMERICANAS SA	39,740	40.82	1,622,186.80	
	LOJAS RENNER S.A.	105,407	39.45	4,158,306.15	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	18.95	5,789,225.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	134,600	26.07	3,509,022.00	
	VIA S/A	135,900	11.20	1,522,080.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	18.88	783,520.00	
	RAIA DROGASIL SA	122,500	26.22	3,211,950.00	
	AMBEV SA	476,800	17.19	8,196,192.00	
	BRF SA	52,500	23.59	1,238,475.00	
	JBS SA	110,000	31.41	3,455,100.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	53.52	5,368,484.16	

	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	100,500	14.93	1,500,465.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	54,400	82.52	4,489,088.00	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	22,600	73.46	1,660,196.00	
	HYPERA SA	35,300	35.08	1,238,324.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	161,367	19.62	3,166,020.54	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	531,802	22.75	12,098,495.50	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	29.67	2,619,861.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	523,681	29.90	15,658,061.90	
	ITAUSA SA	503,167	11.16	5,615,343.72	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	637,309	14.18	9,037,041.62	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	19.75	1,362,750.00	
	TOTVS SA	57,900	36.60	2,119,140.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	43.17	2,257,791.00	
	TIM SA	96,100	11.96	1,149,356.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	38.16	1,411,920.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	37.91	1,273,776.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	113,867	12.18	1,386,900.06	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	79,000	6.64	524,560.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	34,700	32.97	1,144,059.00	
	CPFL ENERGIA SA	43,700	27.55	1,203,935.00	
	ENGIE BRASIL SA	29,250	38.00	1,111,500.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	80,900	24.33	1,968,297.00	
	ブラジルリアル 小計	7,376,891		210,101,812.19 (4,262,566,575)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,440.00	288,061,200.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,580.00	214,824,700.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	12,523	37,700.00	472,117,100.00	
	FALABELLA SA	70,837	3,100.00	219,594,700.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,420.00	195,942,960.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	8,039.70	59,373,184.50	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	71.90	349,623,816.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,456	32,200.00	175,683,200.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	6,279,821	39.70	249,308,893.70	
	CENCOSUD SHOPPING SA	41,600	1,059.90	44,091,840.00	
	COLBUN SA	1,215,680	127.90	155,485,472.00	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	103.00	359,605,445.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	38.26	97,994,496.28	
	チリペソ 小計	18,867,218		2,881,707,007.48 (402,196,965)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	488,979	2,520.00	1,232,227,080.00	
	BANCOLOMBIA SA	29,376	31,600.00	928,281,600.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,278	31,650.00	1,211,498,700.00	

	GRUPO DE INV SURAMERICANA	20,820	19,660.00	409,321,200.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	23,650.00	1,194,585,150.00
	コロンビアペソ 小計	627,964		4,975,913,730.00 (141,251,263)
ユーロ	OPAP SA	18,496	12.10	223,801.60
	JUMBO SA	7,201	12.94	93,180.94
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.09	289,902.96
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	282,775	0.78	220,621.05
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	15.94	417,870.61
	ユーロ 小計	598,347		1,245,377.16 (159,881,519)
イギリスポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	44,689	15.15	677,261.79
	イギリスポンド 小計	44,689		677,261.79 (101,521,542)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	100.40	1,164,941.20
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	18.55	2,165,805.25
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	15.28	1,521,368.48
	KOC HOLDING AS	89,884	22.78	2,047,557.52
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	8.69	2,596,120.12
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	170.90	1,111,020.90
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	71.10	3,044,786.40
	AKBANK T.A.S.	276,321	5.57	1,539,107.97
	TURKIYE GARANTI BANKASI	239,992	9.29	2,229,525.68
	TURKIYE IS BANKASI-C	173,012	5.54	958,486.48
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	15.69	2,245,097.79
	トルコリラ 小計	1,498,297		20,623,817.79 (265,777,077)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,463	828.50	6,183,095.50
	MONETA MONEY BANK AS	14,764	86.55	1,277,824.20
	CEZ AS	18,145	654.00	11,866,830.00
	チェココルナ 小計	40,372		19,327,749.70 (97,243,707)
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	42,355	2,362.00	100,042,510.00
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	9,070.00	137,664,460.00
	OTP BANK NYRT	25,606	17,740.00	454,250,440.00
	ハンガリーフォリント 小計	83,139		691,957,410.00 (253,214,894)
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	30,713	70.74	2,172,637.62
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	200,051	6.26	1,252,719.36
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,132	172.75	2,268,553.00
	LPP SA	124	13,380.00	1,659,120.00
	CD PROJEKT SA	6,704	168.30	1,128,283.20

	CYFROWY POLSAT SA	36,098	35.32	1,274,981.36	
	ALLEGRO.EU SA	39,203	65.01	2,548,587.03	
	DINO POLSKA SA	5,945	338.50	2,012,382.50	
	BANK PEKAO SA	23,647	102.45	2,422,635.15	
	PKO BANK POLSKI SA	93,312	38.96	3,635,435.52	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,615	269.40	973,881.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	62,044	39.98	2,480,519.12	
	ORANGE POLSKA SA	55,658	8.11	451,664.67	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	8.86	562,828.54	
	ポーランドズロチ 小計	633,742		24,844,228.07 (696,078,128)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	5.54	1,063,680.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,495,400	3.53	8,808,762.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	331,000	15.12	5,004,720.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,148,000	3.07	6,594,360.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	142,000	9.80	1,391,600.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	4.40	1,496,000.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	42.40	6,126,800.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	10.74	2,352,060.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	468,000	5.52	2,583,360.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	9.90	4,078,800.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	7.71	2,220,480.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	26,200	149.00	3,903,800.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	83,000	13.84	1,148,720.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	166,000	6.46	1,072,360.00	
	MMG LIMITED	304,000	3.03	921,120.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	129,000	10.30	1,328,700.00	
	PERENNIAL ENERGY HOLDINGS LT	90,000	1.79	161,100.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	50,750	12.96	657,720.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	90,500	6.36	575,580.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	10.40	7,581,600.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	5.53	1,520,750.00	
	BOC AVIATION LTD	23,800	60.60	1,442,280.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.54	693,840.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	159,500	30.45	4,856,775.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	14.26	1,825,280.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	474,000	3.63	1,720,620.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	5.92	1,006,400.00	
	CITIC LTD	617,000	8.21	5,065,570.00	
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	9.68	2,787,840.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	29.00	2,262,000.00	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	9.61	1,537,600.00	

SINOTRUK HONG KONG LTD	54,500	15.38	838,210.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	19.28	4,083,504.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	12.72	1,796,267.52
ZHUZHOU CRRR TIMES ELECTRIC	62,300	46.40	2,890,720.00
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	116,200	7.28	845,936.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	41,500	30.50	1,265,750.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	5.25	2,021,638.50
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	64,000	14.96	957,440.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	164,000	56.40	9,249,600.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	8.33	1,499,400.00
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	4.99	1,067,860.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.35	1,078,800.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	10.88	1,801,151.36
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	4.30	756,800.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	13.94	7,221,617.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	6.06	1,519,690.44
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	156,000	8.43	1,315,080.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	127,922	10.54	1,348,297.88
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	88,000	6.56	577,280.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	368,000	7.30	2,686,400.00
BYD CO LTD-H	83,000	258.40	21,447,200.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	7.19	1,912,540.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	46.90	2,738,960.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	630,000	26.80	16,884,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	352,750	32.30	11,393,825.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	7.19	2,576,493.36
MINTH GROUP LTD	64,000	34.05	2,179,200.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	14.50	1,566,000.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	111,000	167.40	18,581,400.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	194,000	5.75	1,115,500.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	244,600	28.00	6,848,800.00
LI NING CO LTD	237,500	94.75	22,503,125.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	84,800	185.40	15,721,920.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	45,000	7.58	341,100.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	70,000	13.46	942,200.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	96,000	4.40	422,400.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	28.50	3,306,000.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	24.85	1,416,450.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,450,000	0.89	1,290,500.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	65.50	3,379,800.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	26,500	65.75	1,742,375.00
TENCENT HOLDINGS LTD	611,000	421.20	257,353,200.00

ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,607,788	162.10	260,622,434.80
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	54,000	42.15	2,276,100.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	1,206,958	0.78	941,427.24
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	268,000	3.98	1,066,640.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	26,150	67.85	1,774,277.50
MEITUAN-CLASS B	383,000	202.60	77,595,800.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	68,400	15.02	1,027,368.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	10.16	1,158,240.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	68,000	66.65	4,532,200.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	259,000	4.23	1,095,570.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	98.26	1,493,552.00
CHINA FEIHE LTD	346,000	14.36	4,968,560.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	329,000	43.50	14,311,500.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	148,000	62.65	9,272,200.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.95	971,700.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	56,800	39.05	2,218,040.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	115,000	43.40	4,991,000.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	13.16	3,000,480.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	68,000	65.65	4,464,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	7.25	580,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.17	2,895,200.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	44.00	2,112,000.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	52,500	41.00	2,152,500.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	21.60	540,000.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	422,000	11.50	4,853,000.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	124,000	12.12	1,502,880.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	46.85	3,092,100.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	68.10	3,656,970.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	244,000	13.28	3,240,320.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	15.28	1,961,952.00
SINOPHARM GROUP CO-H	125,200	21.10	2,641,720.00
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	20,500	40.85	837,425.00
3SBIO INC	119,000	7.34	873,460.00
AKESO INC	25,000	39.75	993,750.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	10,000	283.80	2,838,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100,000	17.24	1,724,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	956,160	10.90	10,422,144.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	157,500	3.99	628,425.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	166,000	3.86	640,760.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	34.70	4,580,400.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	132.70	676,770.00

HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	25.80	3,147,600.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	114,500	67.20	7,694,400.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	22,300	156.80	3,496,640.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	53.45	3,901,850.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,113,000	6.62	7,368,060.00
SSY GROUP LTD	114,000	5.31	605,340.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	32,088	145.10	4,655,968.80
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	356,000	113.80	40,512,800.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,825,000	2.60	7,345,000.00
BANK OF CHINA LTD-H	8,801,200	2.71	23,851,252.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,098,475	4.54	4,987,076.50
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	366,500	3.09	1,132,485.00
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.54	3,367,248.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,122,620	5.67	57,395,255.40
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.73	1,023,750.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	429,923	66.10	28,417,910.30
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	3.27	2,205,288.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	151,000	2.97	448,470.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	5,924,515	4.36	25,830,885.40
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	5.56	5,888,040.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.39	1,156,480.00
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	134,000	9.04	1,211,360.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.22	2,038,260.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	927,000	1.02	945,540.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	132,000	18.72	2,471,040.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	248,500	19.02	4,726,470.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	8.75	2,100,000.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	14.00	1,240,400.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	6.96	2,486,112.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	135,600	10.96	1,486,176.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	805,000	12.92	10,400,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	296,600	22.60	6,703,160.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	11.48	2,112,595.52
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	22.25	2,144,900.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.41	2,262,990.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	689,288	6.94	4,783,658.72
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	672,000	65.25	43,848,000.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	45,700	35.10	1,604,070.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	142,000	9.07	1,287,940.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	126,000	5.19	653,940.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	186,000	5.00	930,000.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	578,000	2.31	1,335,180.00

CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	415,540	18.22	7,571,138.80
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	80,000	6.67	533,600.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	367,111	27.90	10,242,396.90
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	32,000	41.05	1,313,600.00
CHINA VANKE CO LTD-H	178,400	22.85	4,076,440.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	276,000	5.25	1,449,000.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	800,964	8.20	6,567,904.80
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	10.16	736,600.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	135,200	7.07	955,864.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	60,000	27.45	1,647,000.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	156,000	2.29	357,240.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	152,500	8.81	1,343,525.00
LOGAN GROUP CO LTD	150,000	9.20	1,380,000.00
LONGFOR PROPERTIES	197,000	36.40	7,170,800.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	8,000	45.80	366,400.00
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	178,000	6.45	1,148,100.00
SEAZEN GROUP LTD	204,000	7.20	1,468,800.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	336,000	2.25	756,000.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	15.50	2,053,750.00
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	75,000	17.30	1,297,500.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	251,000	19.38	4,864,380.00
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	64,000	19.28	1,233,920.00
WHARF HOLDINGS	154,000	24.75	3,811,500.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	7.37	851,972.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	131,000	4.66	610,460.00
CHINA YOUZAN LTD	1,456,000	0.79	1,150,240.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	24.00	7,464,000.00
KINGSOFT CORP LTD	92,000	35.85	3,298,200.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	32,000	28.50	912,000.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	13.64	1,077,560.00
WEIMOB INC	149,000	9.73	1,449,770.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	44.10	3,153,150.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	35.35	2,138,675.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	36.15	2,422,050.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	14.38	992,220.00
LENOVO GROUP LTD	732,000	7.84	5,738,880.00
SUNNY OPTICAL TECH	76,800	215.40	16,542,720.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,405,800	24.00	33,739,200.00
ZTE CORP-H	82,908	26.80	2,221,934.40
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	1.03	4,702,980.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	25.15	1,496,425.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	3.04	1,854,400.00

	CGN POWER CO LTD-H	791,000	1.67	1,320,970.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	305,600	23.55	7,196,880.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	339,000	13.00	4,407,000.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.25	1,498,500.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	48.95	5,188,700.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	175,400	14.90	2,613,460.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	83,300	165.10	13,752,830.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	320,000	10.80	3,456,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	370,000	3.23	1,195,100.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	360,000	7.28	2,620,800.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	32.10	2,054,400.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	45,000	42.65	1,919,250.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	531,987	15.36	8,171,320.32	
	香港ドル 小計	92,641,626		1,516,261,471.46	(21,394,449,362)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.60	1,075,536.80	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	18.90	474,390.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	7.97	2,151,103.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	288,600	4.91	1,417,026.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	8.06	307,892.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.20	739,961.20	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	5.78	616,113.32	
	MISC BHD	125,040	6.83	854,023.20	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	70,000	4.26	298,200.00	
	GENTING BHD	188,500	4.70	885,950.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.76	1,020,372.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	5,800	26.08	151,264.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.78	1,021,885.20	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,146	20.00	702,920.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	134.00	964,800.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	18.20	1,337,336.00	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.61	700,128.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	3.79	936,304.34	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	181,300	7.06	1,279,978.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.79	1,327,647.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	128,200	3.09	396,138.00	
	SUPERMAX CORP BHD	161,715	3.08	498,082.20	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	3.77	1,903,473.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	2.88	866,016.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	635,119	4.60	2,921,547.40	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	18.30	1,121,643.60	

	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	17.38	289,081.54
	MALAYAN BANKING BHD	411,105	8.09	3,325,839.45
	PUBLIC BANK BERHAD	1,675,000	3.91	6,549,250.00
	RHB BANK BHD	206,419	5.28	1,089,892.32
	AXIATA GROUP BERHAD	285,289	3.92	1,118,332.88
	DIGI.COM BERHAD	311,700	4.25	1,324,725.00
	MAXIS BHD	267,900	4.40	1,178,760.00
	TELECOM MALAYSIA BHD	70,552	5.84	412,023.68
	PETRONAS GAS BHD	75,500	15.98	1,206,490.00
	TENAGA NATIONAL BHD	305,275	9.90	3,022,222.50
	マレーシアリングット 小計	8,823,359		45,486,347.63 (1,179,538,320)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	134,400	102.50	13,776,000.00
	PTT PCL-NVDR	1,197,400	35.25	42,208,350.00
	THAI OIL PCL-NVDR	120,100	45.50	5,464,550.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	40.50	8,359,200.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	224,934	58.25	13,102,405.50
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	100,600	70.50	7,092,300.00
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,000	414.00	33,534,000.00
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	428,100	58.50	25,043,850.00
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.25	6,740,250.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	8.80	7,123,600.00
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.20	3,403,260.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	32.25	11,698,300.50
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	31.75	5,784,850.00
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	471,035	13.10	6,170,558.50
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	28.50	8,236,500.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	34.00	6,038,400.00
	CP ALL PCL-NVDR	592,000	57.50	34,040,000.00
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	132.50	6,134,750.00
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	26.00	14,466,400.00
	OSOTSPA PCL-NVDR	66,000	37.00	2,442,000.00
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	20.80	3,845,920.00
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	22.50	26,480,250.00
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	129.00	10,668,300.00
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	73,600	38.25	2,815,200.00
	BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	51,900	103.00	5,345,700.00
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	10.40	4,561,960.00
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	88,700	97.25	8,626,075.00
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	165,100	17.10	2,823,210.00
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	59.00	5,988,500.00
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	60.25	5,410,450.00

	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	67.50	5,150,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	49.50	11,201,850.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.00	6,976,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	550.00	21,395,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	119,700	182.50	21,845,250.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	76.00	9,260,600.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	3.06	2,941,911.54	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	43.25	2,309,550.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	175.00	2,957,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	129,400	58.50	7,569,900.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	78.50	5,353,700.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	288,200	37.75	10,879,550.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	54,300	44.25	2,402,775.00	
	タイパーツ 小計	13,153,616		447,668,926.04 (1,472,830,766)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	41.30	9,826,922.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	732.50	20,715,100.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,858	527.00	3,614,166.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	62.80	19,060,616.40	
	SM INVESTMENTS CORP	22,805	999.00	22,782,195.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	96,110	183.00	17,588,130.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	198.00	12,079,980.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	141.00	13,473,960.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	84.40	17,936,266.00	
	BDO UNIBANK INC	219,911	112.00	24,630,032.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	46.20	7,451,459.40	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	2,355,700	3.84	9,045,888.00	
	AYALA LAND INC	794,100	34.75	27,594,975.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,003,150	34.70	34,809,305.00	
	GLOBE TELECOM INC	4,690	2,102.00	9,858,380.00	
	PLDT INC	10,460	1,258.00	13,158,680.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	29,110	290.00	8,441,900.00	
	フィリピンペソ 小計	5,642,999		272,067,954.80 (591,258,079)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY PT	1,439,300	1,295.00	1,863,893,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	19,300.00	3,877,370,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,270.00	2,237,766,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,882,500	1,080.00	3,113,100,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	6,250.00	1,526,250,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	190,000	11,025.00	2,094,750,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,542,100	2,670.00	4,117,407,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	345,600	9,100.00	3,144,960,000.00	

	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,218,400	5,150.00	11,424,760,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	792,300	6,500.00	5,149,950,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	59,600	30,200.00	1,799,920,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	161,000	8,150.00	1,312,150,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,250.00	2,681,875,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	746,400	4,110.00	3,067,704,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,755,900	1,250.00	3,444,875,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	1,154,500	33,000.00	38,098,500,000.00	
	BANK MANDIRI	1,691,296	5,850.00	9,894,081,600.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	5,300.00	4,294,060,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	5,531,700	3,880.00	21,462,996,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,270.00	3,607,562,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,601,300	3,390.00	18,988,407,000.00	
	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	33,698,796		150,387,593,100.00 (1,157,984,466)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS CORP	6,593	40,100.00	264,379,300.00	
	S-OIL CORPORATION	4,447	87,900.00	390,891,300.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,586	230,000.00	1,284,780,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	37,650.00	466,144,650.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	46,500.00	520,288,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	783	499,500.00	391,108,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	182,000.00	345,436,000.00	
	LG CHEM LTD	4,869	894,000.00	4,352,886,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	401,000.00	351,677,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,930	236,000.00	455,480,000.00	
	POSCO	8,093	313,500.00	2,537,155,500.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	148,000.00	495,800,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	748	286,000.00	213,928,000.00	
	SKC CO LTD	1,734	163,500.00	283,509,000.00	
	CJ CORP	1,230	96,000.00	118,080,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	40,700.00	175,335,600.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	28,815	19,500.00	561,892,500.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	6,760	39,200.00	264,992,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	49,050.00	479,120,400.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	5,180	63,900.00	331,002,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,139	31,000.00	221,309,000.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	110,500.00	481,117,000.00	
	LG CORP	9,026	95,100.00	858,372,600.00	
	SAMSUNG C&T CORP	8,727	129,500.00	1,130,146,500.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	21,450.00	397,168,200.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	59,306	5,770.00	342,195,620.00	

SK INC	3,592	259,000.00	930,328,000.00
S-1 CORPORATION	840	80,300.00	67,452,000.00
CJ LOGISTICS	862	167,000.00	143,954,000.00
HMM CO LTD	25,309	38,000.00	961,742,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,586	179,000.00	283,894,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	16,389	28,400.00	465,447,600.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	7,730.00	229,859,280.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	45,300.00	320,089,800.00
HANON SYSTEMS	19,000	15,450.00	293,550,000.00
HYUNDAI MOBIS	7,116	257,500.00	1,832,370,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	14,897	206,500.00	3,076,230,500.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,051	99,000.00	302,049,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	99,500.00	343,175,500.00
KIA CORP	29,259	80,400.00	2,352,423,600.00
COWAY CO LTD	5,058	73,000.00	369,234,000.00
FILA HOLDINGS CORPORATION	4,080	44,000.00	179,520,000.00
HLB INC	10,012	41,300.00	413,495,600.00
LG ELECTRONICS INC	11,019	148,000.00	1,630,812,000.00
KANGWON LAND INC	7,703	25,350.00	195,271,050.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	5,070	22,550.00	114,328,500.00
HYBE CO LTD	1,547	285,000.00	440,895,000.00
KAKAO CORP	33,015	146,500.00	4,836,697,500.00
NAVER CORP	13,066	424,500.00	5,546,517,000.00
NCSOFT CORPORATION	1,643	853,000.00	1,401,479,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	126,500.00	311,822,500.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	67,500.00	310,837,500.00
CJ ENM CO LTD	830	146,800.00	121,844,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,051	84,600.00	258,114,600.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	100,500.00	103,917,000.00
SHINSEGAE CO LTD	881	250,500.00	220,690,500.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	549	162,000.00	88,938,000.00
EMART	1,864	170,500.00	317,812,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	775	434,000.00	336,350,000.00
KT&G CORP	13,223	81,100.00	1,072,385,300.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	115,500.00	362,901,000.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	214,000.00	805,068,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	956	1,437,000.00	1,373,772,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	389	666,000.00	259,074,000.00
PACIFIC CORP	3,393	54,800.00	185,936,400.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,678	114,100.00	990,159,800.00
ALTEOGEN INC	2,841	75,200.00	213,643,200.00
CELLTRION INC	9,922	271,000.00	2,688,862,000.00

	CELLTRION PHARM INC	1,911	161,600.00	308,817,600.00	
	GREEN CROSS CORP	564	306,000.00	172,584,000.00	
	HANMI PHARM CO LTD	499	300,000.00	149,700,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,870	975,000.00	1,823,250,000.00	
	SEEGENE INC	3,838	65,500.00	251,389,000.00	
	SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	3,049	67,300.00	205,197,700.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	115,000.00	367,655,000.00	
	YUHAN CORPORATION	5,817	59,200.00	344,366,400.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	33,962	42,900.00	1,456,969,800.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,000.00	283,300,000.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	42,887	51,300.00	2,200,103,100.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	45,219	37,550.00	1,697,973,450.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	59,406	10,750.00	638,614,500.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	90,200.00	415,100,400.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	4,930.00	236,166,720.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	8,380.00	259,905,700.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	12,350.00	149,521,450.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	45,000.00	259,920,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	58,400.00	245,805,600.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,108	225,000.00	699,300,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	7,417	72,100.00	534,765,700.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	1,451	80,400.00	116,660,400.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	169,500.00	631,387,500.00	
	KMW CO LTD	1,901	48,300.00	91,818,300.00	
	LG DISPLAY CO LTD	24,071	20,250.00	487,437,750.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,415	201,000.00	284,415,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,603	171,000.00	958,113,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	506,823	73,100.00	37,048,761,300.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	88,687	68,500.00	6,075,059,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,892	777,000.00	4,578,084,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	13,900.00	307,537,500.00	
	SK TELECOM	4,398	290,000.00	1,275,420,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	23,650.00	625,755,350.00	
	SK HYNIX INC	58,155	102,500.00	5,960,887,500.00	
	韓国ウォン 小計	1,641,724		125,608,881,120.00 (11,807,234,825)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	91.10	10,225,064.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	43.35	10,151,529.60	
	CHINA STEEL	1,266,261	35.30	44,699,013.30	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	80.20	33,688,892.20	
	FORMOSA PLASTICS CORP	388,824	96.70	37,599,280.80	
	NAN YA PLASTICS CORP	561,752	84.00	47,187,168.00	

TAIWAN CEMENT	486,511	46.20	22,476,808.20
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,000	867.00	10,404,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	28.30	9,849,192.40
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	22,532	313.50	7,063,782.00
EVERGREEN MARINE	266,039	128.00	34,052,992.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	150,000	29.05	4,357,500.00
WAN HAI LINES LIMITED	30,000	213.00	6,390,000.00
YANG MING MARINE TRANSPORT	141,000	126.50	17,836,500.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	37.60	6,657,493.60
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	510.00	10,167,870.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	43,448	200.50	8,711,324.00
GIANT MANUFACTURING	34,464	307.50	10,597,680.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	16,000	411.50	6,584,000.00
POU CHEN	273,780	32.50	8,897,850.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30,000	539.00	16,170,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,544	286.50	17,059,356.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	494,395	69.10	34,162,694.50
ONENESS BIOTECH CO LTD	20,000	185.00	3,700,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	581,846	16.60	9,658,643.60
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,011,237	21.35	42,939,909.95
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,316,970	26.95	35,492,341.50
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,002,216	23.00	23,050,968.00
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	772,097	19.50	15,055,891.50
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,211,339	31.30	37,914,910.70
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,156,889	13.65	15,791,534.85
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	965,570	16.90	16,318,133.00
TAIWAN BUSINESS BANK	500,451	9.62	4,814,338.62
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,057,289	20.95	22,150,204.55
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	330,861	40.55	13,416,413.55
CHAILEASE HOLDING CO LTD	144,167	225.50	32,509,658.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,056,159	23.35	24,661,312.65
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	888,123	53.80	47,781,017.40
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,624,780	13.20	21,447,096.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	326,258	28.35	9,249,414.30
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	712,082	77.00	54,830,314.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,262,866	9.02	11,391,051.32
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	147,660	63.60	9,391,176.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,000	289.00	13,872,000.00
ACER INC	255,803	24.45	6,254,383.35
ADVANTECH CO LTD	43,336	362.00	15,687,632.00
ASUSTEK COMPUTER INC	72,092	311.00	22,420,612.00
AU OPTRONICS CORP	945,090	19.75	18,665,527.50

	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	69,700	175.50	12,232,350.00	
	CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,049,000	19.10	20,035,900.00	
	COMPAL ELECTRONICS	431,760	22.30	9,628,248.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	198,903	269.00	53,504,907.00	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	92,850	64.50	5,988,825.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,319,248	103.00	135,882,544.00	
	INVENTEC CO LTD	280,511	23.80	6,676,161.80	
	LARGAN PRECISION CO LTD	11,040	2,740.00	30,249,600.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	56.90	12,828,218.80	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	60,000	123.50	7,410,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	360.00	7,560,000.00	
	PEGATRON CORP	200,474	64.50	12,930,573.00	
	QUANTA COMPUTER INC	286,270	74.90	21,441,623.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	128,100	51.00	6,533,100.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	118,000	131.00	15,458,000.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	27,000	177.00	4,779,000.00	
	WISTRON CORP	242,695	26.70	6,479,956.50	
	WIWYNN CORP	8,000	889.00	7,112,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	143,692	47.10	6,767,893.20	
	YAGEO CORPORATION	38,764	450.00	17,443,800.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	59,922	95.00	5,692,590.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	410,315	116.50	47,801,697.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	157,000	60.70	9,529,900.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	192,200	103.00	19,796,600.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	359,315	115.50	41,500,882.50	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	1,785.00	5,355,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	777.00	18,648,000.00	
	MEDIATEK INC	159,804	888.00	141,905,952.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	65.70	7,555,500.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,045	470.50	27,310,172.50	
	PHISON ELECTRONICS CORP	22,599	418.50	9,457,681.50	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	69,770	106.00	7,395,620.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,944	517.00	26,338,048.00	
	SILERGY CORP	8,000	3,385.00	27,080,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,615,389	559.00	1,462,002,451.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,230,000	55.50	68,265,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	136.00	12,104,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	324.50	10,384,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	28.90	10,086,100.00	
	新台湾ドル 小計	34,998,996		3,302,606,370.74 (12,966,362,872)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	463.50	44,598,433.50	

COAL INDIA LTD	180,326	138.35	24,948,102.10
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	253.80	15,082,065.00
INDIAN OIL CORP LTD	193,765	106.20	20,577,843.00
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	252,709	113.20	28,606,658.80
PETRONET LNG LTD	83,779	223.65	18,737,173.35
RELIANCE INDUSTRIES LTD	302,723	2,172.65	657,711,125.95
ACC LTD	5,315	2,356.30	12,523,734.50
AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	409.40	30,104,410.20
ASIAN PAINTS LTD	42,204	3,001.55	126,677,416.20
BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	813.70	23,962,651.30
GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,501.20	47,331,334.80
HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	426.95	77,064,901.95
JSW STEEL LTD	80,284	737.45	59,205,435.80
PI INDUSTRIES LTD	8,147	3,183.05	25,932,308.35
PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,225.30	40,498,234.70
SHREE CEMENT LTD	901	26,327.30	23,720,897.30
TATA STEEL LTD	67,202	1,500.45	100,833,240.90
ULTRATECH CEMENT LTD	11,556	7,601.45	87,842,356.20
UNITED PHOSPHORUS LTD	54,204	762.20	41,314,288.80
VEDANTA LTD	147,245	295.90	43,569,795.50
ADANI ENTERPRISES LTD	26,979	1,460.00	39,389,340.00
BHARAT ELECTRONICS LTD	116,287	174.10	20,245,566.70
HAVELLS INDIA LTD	23,476	1,234.15	28,972,905.40
LARSEN & TOUBRO LTD	71,836	1,632.85	117,297,412.60
SIEMENS INDIA LTD	5,926	2,226.70	13,195,424.20
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	45,467	705.40	32,072,421.80
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	673.45	17,816,119.75
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,360	1,697.45	14,190,682.00
BAJAJ AUTO LTD	5,820	3,833.05	22,308,351.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,276.70	20,105,537.70
BHARAT FORGE LTD	30,322	802.90	24,345,533.80
EICHER MOTORS LTD	14,685	2,589.65	38,029,010.25
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,763.60	33,820,936.80
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	83,591	791.35	66,149,737.85
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	13,994	6,840.10	95,720,359.40
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	124,426	214.30	26,664,491.80
MRF LTD	133	79,347.15	10,553,170.95
TATA MOTORS LTD	190,082	293.35	55,760,554.70
PAGE INDUSTRIES LTD	601	30,823.90	18,525,163.90
TITAN INDUSTRIES LTD	40,781	1,880.30	76,680,514.30
JUBILANT FOODWORKS LTD	8,786	4,040.40	35,498,954.40
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	5,482.10	43,061,895.50

TRENT LTD	19,255	900.75	17,343,941.25
AVENUE SUPERMARTS LTD	17,524	3,650.60	63,973,114.40
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,474	3,720.75	42,691,885.50
ITC LTD	289,062	208.95	60,399,504.90
NESTLE INDIA LIMITED	3,198	18,911.00	60,477,378.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	841.40	51,336,338.20
UNITED SPIRITS LTD	32,483	724.45	23,532,309.35
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,668.75	15,963,262.50
DABUR INDIA LTD	58,111	597.40	34,715,511.40
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	38,464	1,005.20	38,664,012.80
HINDUSTAN UNILEVER LTD	89,298	2,486.05	221,999,292.90
MARICO LTD	42,465	523.70	22,238,920.50
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,114	4,787.90	48,424,820.60
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	721.65	25,557,234.75
BIOCON LTD	58,256	370.00	21,554,720.00
CIPLA LTD	49,816	908.85	45,275,271.60
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	4,910.45	72,586,271.90
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,687.05	59,263,060.20
IPCA LABORATORIES LTD	9,167	2,444.35	22,407,356.45
LUPIN LTD	26,552	972.80	25,829,785.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	78,858	782.90	61,737,928.20
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,110	3,052.25	18,649,247.50
AXIS BANK LTD	247,821	754.40	186,956,162.40
BANDHAN BANK LTD	74,811	290.35	21,721,373.85
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	182,172	2,710.75	493,822,749.00
ICICI BANK LTD	543,013	688.30	373,755,847.90
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	56,150	1,749.70	98,245,655.00
STATE BANK OF INDIA	187,504	419.70	78,695,428.80
YES BANK LTD	1,020,164	11.30	11,527,853.20
BAJAJ FINANCE LTD	28,025	6,544.10	183,398,402.50
BAJAJ FINSERV LTD	3,888	15,006.35	58,344,688.80
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	38,543	506.75	19,531,665.25
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,095	2,995.90	12,268,210.50
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,479.40	18,378,586.20
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	11,722	2,701.50	31,666,983.00
REC LTD	142,172	148.05	21,048,564.60
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	1,010.75	31,346,389.75
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	21,216	1,293.85	27,450,321.60
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	94,500	671.05	63,414,225.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,540	1,484.40	34,942,776.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	680.70	21,599,972.40
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,114.05	59,902,468.50

	DLF LTD	56,420	327.10	18,454,982.00
	HCL TECHNOLOGIES LTD	123,161	1,134.25	139,695,364.25
	INFOSYS LTD	362,651	1,733.45	628,637,375.95
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,756	4,981.80	28,675,240.80
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	98,522	3,560.55	350,792,507.10
	TECH MAHINDRA LTD	62,414	1,412.50	88,159,775.00
	WIPRO LTD	144,908	629.40	91,205,095.20
	BHARTI AIRTEL LTD	266,977	622.95	166,313,322.15
	INDUS TOWERS LTD	90,578	218.60	19,800,350.80
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	942.50	40,131,650.00
	ADANI TOTAL GAS LTD	26,949	1,021.80	27,536,488.20
	ADANI TRANSMISSION LTD	27,228	1,075.20	29,275,545.60
	GAIL INDIA LTD	174,768	145.60	25,446,220.80
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	528.10	14,112,944.40
	NTPC LTD	513,123	116.55	59,804,485.65
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	327,337	180.60	59,117,062.20
	インドルピー 小計	8,918,145		7,091,044,395.85 (10,565,656,149)
パキスタンル ピー	LUCKY CEMENT	31,357	848.34	26,601,397.38
	HABIB BANK LTD	66,500	129.76	8,629,040.00
	MCB BANK LTD	53,300	163.50	8,714,550.00
	パキスタンルピー 小計	151,157		43,944,987.38 (29,443,141)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	21,829	18.09	394,886.61
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	296,777	3.03	900,718.19
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.93	859,438.80
	INDUSTRIES QATAR	196,788	13.09	2,575,954.92
	COMMERCIAL BANK QSC	203,990	5.90	1,203,541.00
	MASRAF AL RAYAN	406,540	4.48	1,823,331.90
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	9.52	938,281.68
	QATAR ISLAMIC BANK	114,230	18.03	2,059,566.90
	QATAR NATIONAL BANK	448,253	19.18	8,597,492.54
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	3.08	639,069.20
	OOREDOO QSC	72,800	7.00	509,600.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	62,421	16.92	1,056,163.32
	カタールリアル 小計	2,573,602		21,558,045.06 (646,094,610)
南アフリカラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	22,520	172.65	3,888,078.00
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	276.43	4,055,228.10
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	6,119	1,577.15	9,650,580.85
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	39,424	241.22	9,509,857.28
	GOLD FIELDS LTD	97,102	134.27	13,037,885.54

	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	54.02	3,041,380.02	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	79,345	221.80	17,598,721.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	615.63	3,307,164.36	
	NORTHAM PLATINUM LTD	33,950	201.85	6,852,807.50	
	SASOL LTD	57,207	197.08	11,274,355.56	
	SIBANYE STILLWATER LTD	313,727	58.25	18,274,597.75	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	202.14	5,599,682.28	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	117.97	4,781,206.13	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	234.60	6,688,446.00	
	NASPERS LTD-N SHS	23,206	2,379.71	55,223,550.26	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	60.08	6,638,539.60	
	BID CORP LTD	35,017	320.00	11,205,440.00	
	CLICKS GROUP LTD	26,921	295.61	7,958,116.81	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	44,265	166.99	7,391,812.35	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	200.47	4,665,738.78	
	TIGER BRANDS LTD	13,023	187.41	2,440,640.43	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,244	187.86	6,996,657.84	
	ABSA GROUP LTD	73,296	150.36	11,020,786.56	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,544	1,826.72	15,607,495.68	
	NEDBANK GROUP LTD	38,037	172.28	6,553,014.36	
	STANDARD BANK GROUP LTD	150,257	136.24	20,471,013.68	
	FIRSTSTRAND LTD	560,323	59.19	33,165,518.37	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	284.47	4,889,185.89	
	REMGRO LTD	55,441	114.10	6,325,818.10	
	DISCOVERY LIMITED	48,488	127.88	6,200,645.44	
	OLD MUTUAL LTD	489,612	14.04	6,874,152.48	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HD	101,268	32.19	3,259,816.92	
	SANLAM LTD	214,053	63.59	13,611,630.27	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	60,556	102.55	6,210,017.80	
	MTN GROUP LTD	173,000	132.90	22,991,700.00	
	VODACOM GROUP	62,331	138.91	8,658,399.21	
	南アフリカランド 小計	3,188,316		385,919,681.20 (2,782,480,901)	
アラブ首長国連 邦ディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	271,405	4.48	1,215,894.40	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	7.47	2,442,973.86	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	5.50	1,021,795.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	215,945	5.06	1,092,681.70	
	EMIRATES NBD PJSC	265,296	13.50	3,581,496.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	486,542	16.82	8,183,636.44	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	367,539	4.12	1,514,260.68	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	385,040	4.08	1,570,963.20	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	174,383	24.18	4,216,580.94	

アラブ首長国連邦ディルハム 小計		2,678,969		24,840,282.72 (744,463,273)
クウェートディ ナール	AGILITY	142,931	0.99	142,359.27
	BOUBYAN BANK K.S.C	130,019	0.78	101,674.85
	KUWAIT FINANCE HOUSE	514,294	0.80	414,006.67
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	722,881	0.89	647,701.37
	MABANEE CO KPSC	67,003	0.73	49,314.20
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	215,000	0.59	128,570.00
クウェートディナール 小計		1,792,128		1,483,626.36 (542,547,323)
香港・オフショ ア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	109,080	3.98	434,138.40
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	17.39	347,800.00
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	4.44	444,000.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	38,300	10.72	410,576.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	87,800	13.05	1,145,790.00
	YANZHOU COAL MINING CO-A	61,200	16.66	1,019,592.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.88	966,084.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	41.25	1,214,400.00
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	8.41	325,467.00
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	78,847	14.92	1,176,397.24
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	53,400	41.28	2,204,352.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	8,000	177.66	1,421,280.00
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	5,000	31.55	157,750.00
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	12,413	124.80	1,549,142.40
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	28.69	1,064,399.00
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	19.11	191,100.00
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	2.56	1,180,160.00
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	5.00	300,000.00
	JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	66,900	25.50	1,705,950.00
	JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	38,570	6.93	267,290.10
	KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	30,400	20.23	614,992.00
	LB GROUP CO LTD-A	15,300	32.00	489,600.00
	NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	16.34	1,294,128.00
	PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	220,100	3.09	680,109.00
	RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	19.04	922,488.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	17.55	127,272.60
	SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	33.89	607,986.60
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	5.53	1,584,898.00	
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	5,100	45.93	234,243.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	5,600	155.98	873,488.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	6,000	114.20	685,200.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	4,100	12.81	52,521.00	

TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	25.52	250,096.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	92,200	7.52	693,344.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	106.98	1,872,150.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	82.43	760,004.60
YINTAI GOLD CO LTD-A	111,300	8.93	993,909.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	10,400	258.30	2,686,320.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	5,700	130.88	746,016.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	23,600	12.86	303,496.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	34,000	8.08	274,720.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	64.95	740,430.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	36.70	308,280.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	4.70	991,230.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	13,400	503.00	6,740,200.00
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	103.48	783,654.04
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	139,400	9.81	1,367,514.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	53.16	308,328.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	191.80	1,208,340.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	13,600	42.69	580,584.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	102.19	1,170,688.64
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.86	1,277,274.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	58,320	30.82	1,797,422.40
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	6.05	987,360.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	28.26	1,184,094.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	10,650	71.19	758,173.50
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	154,700	6.62	1,024,114.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	137.17	1,371,700.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	22,600	7.06	159,556.00
TBEA CO LTD-A	99,019	16.45	1,628,862.55
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	19.67	849,744.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.39	1,274,166.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	12.98	261,040.78
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	28,280	42.78	1,209,818.40
YUTONG BUS CO LTD-A	44,300	11.79	522,297.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	50.60	1,598,960.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	67.46	557,219.60
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	47,190	24.13	1,138,694.70
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	8.09	648,009.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	80,600	7.22	581,932.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	73.30	806,300.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	7.10	183,890.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	106,700	4.47	476,949.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.74	189,600.00

S F HOLDING CO LTD-A	20,300	57.74	1,172,122.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	39.86	212,015.34
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.11	226,884.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	8,300	51.64	428,612.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	14.30	312,312.00
BYD CO LTD -A	9,700	293.72	2,849,084.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	33,348	22.42	747,662.16
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	48.39	895,215.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	21.11	724,073.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	24.12	706,716.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	18.75	798,750.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	177.88	498,064.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	41.84	1,161,478.40
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	6,102	74.20	452,768.40
MIDEA GROUP CO LTD-A	11,600	71.94	834,504.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	12.46	413,672.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	148.91	1,146,607.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	26.84	697,840.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	3,000	19.94	59,820.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	7.41	755,820.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	52.04	416,320.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	97,400	11.25	1,095,750.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	45.52	1,192,624.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	7.05	559,065.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	13.56	453,988.80
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	9.17	491,512.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	7.41	1,032,954.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	55.30	901,390.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	16,500	9.05	149,325.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	15.02	342,456.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	24,500	17.80	436,100.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	5.49	337,635.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	236.09	2,880,298.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	17,000	22.13	376,210.00
SUNING.COM CO LTD-A	45,800	5.43	248,694.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	15,480	49.38	764,402.40
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	8,600	52.57	452,102.00
SHANGHAI BAILIAN GROUP CO-A	60,340	14.34	865,275.60
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	55.33	561,046.20
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	40,500	4.07	164,835.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	46.78	500,546.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	198.00	316,800.00

ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	54.57	120,054.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	7.69	457,555.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	10,300	32.54	335,162.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	10,000	41.46	414,600.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	155.87	1,231,373.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	30.20	138,920.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	18,408	110.42	2,032,611.36
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	3,000	169.99	509,970.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	19.57	536,218.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	66.52	1,130,840.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	24.98	29,976.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	33.38	1,145,000.76
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	42.49	735,077.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	169.97	1,546,727.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	27,700	9.17	254,009.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	209.15	1,171,240.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	33.64	386,860.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	68.80	481,600.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,600	1,619.97	12,311,772.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	176.82	1,732,836.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	44.88	1,506,083.04
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	11.72	314,096.00
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	16,800	20.53	344,904.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	299.11	2,805,651.80
TONGWEI CO LTD-A	31,600	49.02	1,549,032.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	13.11	500,277.60
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	21,200	222.65	4,720,180.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	70.49	711,949.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	19.56	103,668.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	27.91	828,927.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	23,226	50.07	1,162,925.82
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	6,500	61.20	397,800.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	33,700	31.03	1,045,711.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	127.25	361,135.50
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	38.99	378,982.80
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	5,250	104.99	551,197.50
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	54.93	678,385.50
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	18,000	37.70	678,600.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	14.54	151,216.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	26.17	387,316.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	7.51	186,548.40
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	82.79	596,833.11

SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	335.27	2,816,268.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	301.66	603,320.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	37,830	13.67	517,136.10
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	352.75	70,550.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	23,400	35.07	820,638.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	103.15	567,325.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	285.00	627,000.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	24.31	247,962.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	151.10	1,495,890.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	30.73	681,990.89
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	30.79	492,640.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	147.18	1,177,440.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	36.40	686,140.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	53.84	2,051,411.68
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	21,294	30.40	647,337.60
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.25	464,725.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	6,800	136.32	926,976.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	26.14	182,980.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	59,640	17.81	1,062,188.40
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	17.82	200,154.24
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	19,500	10.74	209,430.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	81.06	1,378,020.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	130.75	2,152,668.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	26,100	15.56	406,116.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	7,100	92.08	653,768.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	3,900	378.34	1,475,526.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	17.99	162,269.80
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	29,040	28.79	836,061.60
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	58.94	571,718.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	2.94	1,039,584.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.36	252,880.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.38	433,182.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	75,140	6.74	506,443.60
BANK OF NANJING CO LTD -A	50,500	9.01	455,005.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	24,000	35.25	846,000.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	7.26	330,330.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	5.93	740,657.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.39	436,971.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	104,900	51.58	5,410,742.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	4.01	1,097,136.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	3.61	1,114,046.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.57	665,058.00

IND & COMM BK OF CHINA-A	261,200	4.64	1,211,968.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	18.55	1,765,960.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	20.34	2,428,596.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.15	728,725.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	9.23	1,276,509.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.92	480,200.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	15.27	1,212,438.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	44,100	10.52	463,932.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	7.44	148,056.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	11.74	548,258.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	18.16	520,465.60
CITIC SECURITIES CO-A	43,200	24.64	1,064,448.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	29.35	707,335.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	41,880	32.08	1,343,510.40
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	15.76	56,736.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	6.75	406,350.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	82,800	8.60	712,080.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	20.29	1,229,574.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	94,200	11.74	1,105,908.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	17.54	1,268,142.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.56	1,149,498.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	116.15	627,210.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	56,420	5.31	299,590.20
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	16.13	508,095.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	87,900	10.99	966,021.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	42,700	11.27	481,229.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	31,700	16.22	514,174.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	69,616	8.82	614,013.12
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.64	961,408.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	5.10	581,400.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	94,600	4.41	417,186.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	12.04	526,148.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	27.19	494,858.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	53.71	3,587,828.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	18,200	4.16	75,712.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	9.99	546,453.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	23.15	1,243,155.00
GEMDALE CORP-A	45,500	11.00	500,500.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	123,480	4.43	547,016.40
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	70,360	5.08	357,428.80
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	11.80	965,240.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	35.77	457,856.00

SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	8,500	16.80	142,800.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	12.02	323,338.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	18,900	18.22	344,358.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	28,800	15.35	442,080.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	6,700	52.33	350,611.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	78,400	16.28	1,276,352.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	7.05	392,685.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	12,740	55.76	710,382.40
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	52.40	565,920.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	263.90	791,700.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	6,110	67.39	411,752.90
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	126.77	697,235.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	36.15	476,095.50
ADDSINO CO LTD -A	5,800	22.20	128,760.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	5.78	662,388.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	41.50	1,162,000.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	15.45	537,660.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	20,800	19.44	404,352.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	11.85	534,435.00
GOERTEK INC -A	26,900	39.28	1,056,632.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	7.09	354,500.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	117.02	819,140.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	30.26	596,485.12
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	24.32	408,576.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	37.70	1,751,165.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,080	429.84	464,227.20
NINESTAR CORP-A	18,543	34.85	646,223.55
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	7.59	237,567.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	25.36	616,248.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	95.40	454,104.00
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	23,500	16.96	398,560.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	13,400	25.54	342,236.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	19.25	548,625.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	14.48	680,560.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	25.02	458,866.80
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	2,800	13.82	38,696.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	103.12	433,104.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	29,512	29.07	857,913.84
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	23,360	75.33	1,759,708.80
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	87.01	978,862.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	20.49	620,847.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	38.55	335,385.00

	ZTE CORP-A	12,600	36.29	457,254.00
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	5.10	886,380.00
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	134,000	19.92	2,669,280.00
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	67,600	8.89	600,964.00
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	150,000	6.23	934,500.00
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	4.82	397,650.00
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	6,272	167.02	1,047,549.44
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	10,800	125.24	1,352,592.00
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	58.10	435,750.00
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	34.35	1,023,630.00
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	33,600	80.39	2,701,104.00
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	362.48	1,123,688.00
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	40,600	36.96	1,500,576.00
	SG MICRO CORP-A	2,100	337.95	709,695.00
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2,600	108.13	281,138.00
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	29,500	46.61	1,374,995.00
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	12.50	409,375.00
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	20.05	450,443.30
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	4,900	196.32	961,968.00
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5,400	264.99	1,430,946.00
	香港・オフショア人民元 小計	13,780,807		263,833,755.82 (4,462,695,212)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	23,559	23.40	551,280.60
	SAUDI ARABIAN OIL CO	238,091	34.95	8,321,280.45
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,804	72.50	710,790.00
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	20.86	666,018.08
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	13,666	45.10	616,336.60
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	24,254	124.00	3,007,496.00
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	32,283	33.60	1,084,708.80
	SAUDI ARABIAN MINING CO	44,984	69.80	3,139,883.20
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	97,353	121.60	11,838,124.80
	SAUDI CEMENT	7,489	63.40	474,802.60
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	21,059	35.45	746,541.55
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,114	18.56	1,227,075.84
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	68.10	1,808,463.60
	JARIR MARKETING CO	7,199	204.40	1,471,475.60
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,725	114.00	424,650.00
	ALMARAI CO	30,130	55.90	1,684,267.00
	SAVOLA	25,336	39.20	993,171.20
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	6,923	183.00	1,266,909.00
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	4,029	197.40	795,324.60
	AL RAJHI BANK	130,773	122.20	15,980,460.60

ALINMA BANK	109,956	22.44	2,467,412.64
ARAB NATIONAL BANK	57,638	22.30	1,285,327.40
BANK AL-JAZIRA	35,813	18.58	665,405.54
BANK ALBILAD	45,859	42.10	1,930,663.90
BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	40.50	2,735,208.00
RIYAD BANK	138,943	27.45	3,813,985.35
SAUDI BRITISH BANK	94,400	34.20	3,228,480.00
THE SAUDI NATIONAL BANK	236,442	59.00	13,950,078.00
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,063	156.80	950,678.40
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,613	95.20	629,557.60
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	47,092	10.22	481,280.24
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	12.46	575,490.02
ETIHAD ETISALAT CO	34,414	31.60	1,087,482.40
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	26,891	13.80	371,095.80
SAUDI TELECOM CO	66,310	131.20	8,699,872.00
SAUDI ELECTRICITY CO	92,221	26.45	2,439,245.45
サウジアラビアリアル 小計	1,957,633		102,120,322.86 (2,997,231,475)
合 計	266,796,631		89,391,000,085 (89,391,000,085)

(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	6,719,504.00	
		メキシコペソ 小計	58,400	6,719,504.00 (36,643,471)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	3,718,820.00	
		BANCO INTER SA-UNITS	31,500	2,034,270.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,845,639.00	
		ENERGISA SA-UNITS	16,500	719,895.00	
	KLABIN SA-UNIT	64,600	1,543,940.00		
ブラジルリアル 小計	290,000	9,862,564.00 (200,092,684)			
投資信託受益証券合計			348,400	236,736,155 (236,736,155)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	6,544,248.00	
		メキシコペソ 小計	308,400	6,544,248.00 (35,687,747)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	7,362,913.54	

	南アフリカランド 小計	478,733	7,362,913.54 (53,086,606)	
	投資証券合計	787,133	88,774,353 (88,774,353)	
	合計		325,510,508 (325,510,508)	

(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 73銘柄	100.0%			8.9%
メキシコペソ	株式 21銘柄	96.0%			1.9%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.0%		0.0%
	投資証券 1銘柄			2.0%	0.0%
ブラジルリアル	株式 48銘柄	95.5%			4.8%
	投資信託受 益証券 5銘柄		4.5%		0.2%
チリペソ	株式 13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 5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%			0.1%
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 14銘柄	100.0%			0.8%
香港ドル	株式 213銘柄	100.0%			23.8%
マレーシアリングギット	株式 36銘柄	100.0%			1.3%
タイバーツ	株式 43銘柄	100.0%			1.6%
フィリピンペソ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%			1.3%
韓国ウォン	株式 102銘柄	100.0%			13.2%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%			14.5%
インドルピー	株式 101銘柄	100.0%			11.8%
パキスタンルピー	株式 3銘柄	100.0%			0.0%

カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			0.7%
南アフリカランド	株式	36銘柄	98.1%			3.1%
	投資証券	1銘柄			1.9%	0.1%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	9銘柄	100.0%			0.8%
クウェートディナール	株式	6銘柄	100.0%			0.6%
香港・オフショア人民元	株式	304銘柄	100.0%			5.0%
サウジアラビアリアル	株式	36銘柄	100.0%			3.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	438,276,768
コール・ローン	1,168,586,629
国債証券	71,516,662,857
派生商品評価勘定	40,780
未収利息	897,827,413
前払費用	102,505,793
流動資産合計	74,123,900,240
資産合計	74,123,900,240
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	46,458
未払解約金	6,052,137
未払利息	2,095
流動負債合計	6,100,690
負債合計	6,100,690
純資産の部	
元本等	
元本	42,682,968,944
剰余金	
剰余金又は欠損金()	31,434,830,606
元本等合計	74,117,799,550
純資産合計	74,117,799,550

	2021年 8月20日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	74,123,900,240

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買取相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買取相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	42,682,968,944口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7365円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (17,365円)</p>

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 8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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2.金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8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ぬ。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(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。

	2021年 8月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月21日
期首元本額	35,819,777,048円
期中追加設定元本額	9,331,615,788円
期中一部解約元本額	2,468,423,892円
期末元本額	42,682,968,944円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,511,043,667円
世界経済インデックスファンド	8,715,561,537円
DC 新興国債券インデックス・オープン	4,966,661,331円
DC 世界経済インデックスファンド	9,592,620,638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）	1,807,522,204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）	87,805,991円
分散投資コア戦略ファンドA	224,890,391円
分散投資コア戦略ファンドS	482,336,271円

区分	2021年 8月20日現在
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	386,034,619円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,151,439,228円
コア投資戦略ファンド(切替型)	114,516,341円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	190,192,099円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	87,326,318円
S M T インデックスバランス・オープン	160,070,041円
外国債券S M T Bセレクション(S M A専用)	3,815,368,676円
S M T 世界経済インデックス・オープン	243,946,900円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	274,834,298円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	447,230,054円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	6,267,064円
グローバル経済コア	638,681,278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)	5,024,122円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	6,784,122円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	4,658,908円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	2,028,711円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	1,774,758円
F O F s用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	76,868,412円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	275,621,346円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	57,039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)	3,993円
S M T A M海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	305,581,664円
S M T A M海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	318,501,918円
S M T A M海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	307,694,397円
S M T A M海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	305,551,834円
S M T A M海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	292,663,837円
S M T A M海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	286,221,307円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年 8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	2,647,112,300
合計	2,647,112,300

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

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	5,574,507	-	5,528,049	46,458
	アメリカドル	5,574,507	-	5,528,049	46,458
	売建	5,574,507	-	5,533,727	40,780
	ロシアルーブル	5,574,507	-	5,533,727	40,780
合計		11,149,014	-	11,061,776	5,678

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	30,800,000.00	38,157,196.00	
		MBONO 10% 12/05/24	100,250,000.00	111,407,825.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	136,300,000.00	131,924,770.00	
		MBONO 6.5% 06/09/22	103,700,000.00	104,642,633.00	
		MBONO 6.75% 03/09/23	92,600,000.00	94,178,830.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	112,447,317.50	
		MBONO 7.75% 05/29/31	76,600,000.00	80,432,298.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	77,000,000.00	78,138,060.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	32,600,000.00	34,038,638.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000.00	127,632,589.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	64,400,000.00	70,183,120.00	
		MBONO 8% 09/05/24	86,400,000.00	90,729,504.00	
		MBONO 8% 11/07/47	68,100,000.00	70,562,496.00	
		MBONO 8% 12/07/23	97,950,000.00	102,345,996.00	

メキシコペソ 小計		1,192,250,000.00	1,246,821,272.50 (6,799,290,445)
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000.00	74,430,670.26
	BLTN 0% 07/01/22	22,350,000.00	20,922,056.26
	BLTN 0% 07/01/23	51,200,000.00	43,572,121.60
	BLTN 0% 07/01/24	13,500,000.00	10,373,707.80
	BNTNF 10% 01/01/23	47,550,000.00	48,355,426.19
	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000.00	32,007,543.04
	BNTNF 10% 01/01/27	31,400,000.00	31,038,774.74
	BNTNF 10% 01/01/29	17,400,000.00	16,996,889.17
	BNTNF 10% 01/01/31	11,050,000.00	10,578,481.14
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,463,875.00
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,927,312.50
ブラジルレアル 小計		321,650,000.00	291,666,857.70 (5,917,366,375)
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	675,000,000.00	584,040,421.57
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,535,000,000.00	2,451,013,366.23
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,690,000,000.00	1,729,790,240.49
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,630,000,000.00	1,621,527,349.65
	BTPCL 4% 03/01/23	840,000,000.00	855,515,375.40
	BTPCL 5% 03/01/35	1,890,000,000.00	1,884,024,492.84
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	682,826,055.12
	BTPCL 6% 01/01/43	1,480,000,000.00	1,614,281,616.56
チリペソ 小計		11,400,000,000.00	11,423,018,917.86 (1,594,299,327)
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	72,300,000,000.00	85,674,777,000.00
	COLTES 6.25% 11/26/25	10,500,000,000.00	10,681,755,000.00
	COLTES 7.25% 10/18/34	22,600,000,000.00	21,919,966,000.00
コロンビアペソ 小計		105,400,000,000.00	118,276,498,000.00 (3,357,514,948)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	3,053,271.00
	PERUGB 5.4% 08/12/34	5,600,000.00	4,701,312.00
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,200,000.00	3,390,080.00
	PERUGB 5.94% 02/12/29	6,970,000.00	6,897,442.30
	PERUGB 6.15% 08/12/32	6,300,000.00	5,949,846.00
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,700,000.00	7,842,219.00
	PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	6,534,737.50
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,700,000.00	7,920,836.00
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	6,504,958.00
ペルーヌエボソル 小計		54,020,000.00	52,794,701.80 (1,412,812,617)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	25,355,750.00
	URUGUA 8.5% 03/15/28	12,500,000.00	12,996,875.00

ウルグアイペソ 小計		37,500,000.00	38,352,625.00 (97,511,549)
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	21,675,000.00
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	29,153,500.00
ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	50,828,500.00 (97,773,702)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,372,312.50
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	6,578,671.00
	TURKGB 10.6% 02/11/26	11,050,000.00	8,790,717.00
	TURKGB 10.7% 08/17/22	8,650,000.00	8,095,881.00
	TURKGB 11.7% 11/13/30	12,400,000.00	9,443,716.00
	TURKGB 11% 02/24/27	7,400,000.00	5,797,974.00
	TURKGB 11% 03/02/22	7,350,000.00	7,089,589.50
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,222,642.00
	TURKGB 12.4% 03/08/28	4,700,000.00	3,856,867.00
	TURKGB 12.6% 10/01/25	14,400,000.00	12,411,216.00
	TURKGB 16.2% 06/14/23	7,100,000.00	6,911,992.00
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,326,792.00
	TURKGB 8.5% 09/14/22	5,100,000.00	4,646,559.00
	TURKGB 8% 03/12/25	8,300,000.00	6,271,978.00
	TURKGB 9% 07/24/24	13,750,000.00	11,156,475.00
	トルコリラ 小計		128,900,000.00
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	31,100,000.00	27,027,144.00
	CZGB 0.25% 02/10/27	53,700,000.00	49,516,233.00
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	45,881,400.00
	CZGB 0.95% 05/15/30	54,900,000.00	51,145,389.00
	CZGB 1.2% 03/13/31	46,000,000.00	43,521,980.00
	CZGB 1.75% 06/23/32	23,000,000.00	22,902,480.00
	CZGB 1% 06/26/26	59,200,000.00	57,169,440.00
	CZGB 2.4% 09/17/25	42,900,000.00	44,020,548.00
	CZGB 2.5% 08/25/28	64,800,000.00	67,852,080.00
	CZGB 2.75% 07/23/29	50,300,000.00	53,849,168.00
	CZGB 2% 10/13/33	52,200,000.00	53,048,250.00
	CZGB 4.2% 12/04/36	28,000,000.00	36,345,680.00
	CZGB 4.7% 09/12/22	35,800,000.00	37,203,360.00
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	41,880,930.00
チェココルナ 小計		626,600,000.00	631,364,082.00 (3,176,582,105)
ハンガリーフォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	594,645,315.00
	HGB 1.5% 08/23/23	322,500,000.00	325,618,575.00
	HGB 1.5% 08/26/26	274,000,000.00	265,804,660.00

	HGB 1.75% 10/26/22	275,000,000.00	278,349,500.00	
	HGB 1% 11/26/25	475,000,000.00	455,183,000.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	382,000,000.00	362,319,360.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	557,611,920.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	484,996,105.00	
	HGB 2% 05/23/29	223,000,000.00	218,495,400.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	692,000,000.00	736,765,480.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	415,444,400.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	583,665,750.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	619,954,240.00	
	HGB 3% 10/27/38	340,000,000.00	332,180,000.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	744,902,400.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	471,000,000.00	519,710,820.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	262,000,000.00	340,445,420.00	
	HGB 7% 06/24/22	250,000,000.00	262,990,000.00	
ハンガリーフォリント 小計		7,805,000,000.00	8,099,082,345.00 (2,963,778,193)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	10,500,000.00	10,011,960.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	12,850,000.00	12,875,571.50	
	POLGB 1.25% 10/25/30	15,200,000.00	14,820,912.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,187,800.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	18,874,963.50	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	20,537,198.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,250,000.00	14,998,695.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	25,782,662.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,400,000.00	15,469,776.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	18,800,000.00	20,620,216.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	21,550,000.00	23,751,763.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,483,575.00	
	POLGB 4% 10/25/23	10,850,000.00	11,702,484.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	12,550,000.00	13,327,472.50	
ポーランドズロチ 小計		218,150,000.00	229,445,049.50 (6,428,522,563)	
ロシアルーブル	RFLB 4.5% 07/16/25	270,000,000.00	249,779,700.00	
	RFLB 5.7% 05/17/28	219,000,000.00	206,157,840.00	
	RFLB 6.1% 07/18/35	214,500,000.00	195,932,880.00	
	RFLB 6.5% 02/28/24	149,000,000.00	148,342,910.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	159,072,820.00	
	RFLB 6% 10/06/27	217,500,000.00	209,602,575.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	162,500,000.00	164,924,500.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	165,100,000.00	166,807,134.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	210,400,000.00	213,543,376.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	163,406,655.00	

	RFLB 7.4% 07/17/24	202,200,000.00	205,758,720.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	166,762,557.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	117,700,000.00	118,853,460.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	221,500,000.00	233,693,575.00	
	RFLB 7.7% 03/16/39	133,500,000.00	141,445,920.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	167,405,740.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	141,500,000.00	147,584,500.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	190,573,090.00	
	RFLB 7% 01/25/23	71,200,000.00	71,644,288.00	
	RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	107,844,272.00	
	RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	165,951,240.00	
	RFLB 8.5% 09/17/31	116,650,000.00	130,508,020.00	
	ロシアルーブル 小計	3,698,050,000.00	3,725,595,772.00 (5,513,881,742)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	8,700,000.00	8,280,660.00	
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,312,946.00	
	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000.00	23,417,822.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	10,950,000.00	11,291,640.00	
	MGS 3.733% 06/15/28	9,000,000.00	9,376,200.00	
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	4,995,742.50	
	MGS 3.757% 05/22/40	7,550,000.00	7,219,310.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,349,707.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,192,538.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	27,250,000.00	28,550,915.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	14,800,000.00	15,622,584.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,541,130.50	
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	9,183,546.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	27,391,260.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	10,900,000.00	11,450,559.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	6,600,000.00	6,385,698.00	
	MGS 4.181% 07/15/24	7,600,000.00	7,988,892.00	
MGS 4.254% 05/31/35	12,000,000.00	12,552,600.00		
MGS 4.762% 04/07/37	7,350,000.00	8,021,496.00		
	マレーシアリンギット 小計	213,600,000.00	221,125,246.50 (5,734,153,554)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	91,208,615.00	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	116,700,000.00	118,529,856.00	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	99,000,000.00	102,125,430.00	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	56,800,000.00	54,634,784.00	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	44,100,000.00	42,668,955.00	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	85,100,000.00	86,979,008.00	
	THAIGB 1.875% 06/17/22	59,300,000.00	60,009,821.00	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	130,600,000.00	140,213,466.00	

	THAIGB 2.4% 12/17/23	91,000,000.00	95,092,270.00	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	83,200,000.00	93,675,712.00	
	THAIGB 2% 06/17/42	65,600,000.00	62,894,656.00	
	THAIGB 2% 12/17/22	65,000,000.00	66,340,950.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000.00	207,974,634.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	129,200,000.00	152,936,624.00	
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	88,837,560.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	97,300,000.00	116,210,255.00	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	104,000,000.00	125,801,520.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	97,400,000.00	110,827,564.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000.00	133,325,625.00	
	タイバーツ 小計	1,783,000,000.00	1,950,287,305.00 (6,416,445,233)	
フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,116,700.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	36,013,500.00	
	フィリピンペソ 小計	45,000,000.00	51,130,200.00 (111,116,150)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,348,307,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,770,966,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	33,500,000,000.00	33,986,755,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	60,300,000,000.00	61,987,797,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	45,000,000,000.00	45,633,150,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,685,724,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	53,000,000,000.00	53,718,680,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	70,100,000,000.00	73,972,324,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	31,000,000,000.00	31,068,200,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	35,686,060,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	21,000,000,000.00	21,925,260,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	27,200,000,000.00	28,512,672,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	21,900,000,000.00	23,385,696,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	36,923,509,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	39,464,688,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	54,000,000,000.00	56,649,240,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	39,022,584,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,700,000,000.00	35,789,934,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	35,388,312,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,400,000,000.00	20,731,464,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	46,600,000,000.00	51,069,406,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	58,630,520,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	24,002,428,000.00	
INDOGB 8.375% 09/15/26	29,100,000,000.00	33,074,478,000.00		
INDOGB 8.75% 05/15/31	34,700,000,000.00	40,664,930,000.00		

	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,917,804,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	19,700,000,000.00	23,105,539,000.00	
インドネシアルピア 小計		897,200,000,000.00	965,116,427,000.00	(7,431,396,487)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	123,900,000.00	140,889,168.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	43,600,000.00	30,663,880.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	34,100,000.00	22,642,741.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	38,900,000.00	40,441,996.00	
	SAGB 7% 02/28/31	50,200,000.00	43,034,954.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	80,700,000.00	73,411,176.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	75,700,000.00	64,429,784.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	57,169,332.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	97,100,000.00	81,367,858.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	55,733,610.00	
	SAGB 8% 01/31/30	103,700,000.00	98,080,497.00	
	SAGB 9% 01/31/40	64,450,000.00	56,152,707.00	
	南アフリカランド 小計		842,250,000.00	764,017,703.00
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	20,000,000.00	19,532,800.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	18,000,000.00	17,971,200.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,764,647.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,794,770.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000.00	30,568,015.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	17,049,058.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,245,870.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	5,000,000.00	5,051,150.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,634,470.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000.00	28,394,240.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	17,500,000.00	17,771,075.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,371,000.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	20,700,000.00	21,033,477.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	29,400,000.00	29,948,898.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,270,720.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,562,760.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	14,900,000.00	15,321,521.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,725,120.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	20,000,000.00	20,554,600.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,798,460.00	
CGB 3.29% 10/18/23	16,000,000.00	16,299,520.00		
CGB 3.72% 04/12/51	6,100,000.00	6,473,686.00		
CGB 3.81% 09/14/50	23,700,000.00	25,295,721.00		
香港・オフショア人民元 小計		439,200,000.00	446,432,778.00	(7,551,321,153)

合計		71,516,662,857 (71,516,662,857)	
----	--	------------------------------------	--

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.5%
ブラジルレアル	国債証券 11銘柄	100.0%	8.3%
チリペソ	国債証券 8銘柄	100.0%	2.2%
コロンビアペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	4.7%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.0%
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 15銘柄	100.0%	2.0%
チェココルナ	国債証券 14銘柄	100.0%	4.4%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	4.1%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.0%
ロシアルーブル	国債証券 22銘柄	100.0%	7.7%
マレーシアリングット	国債証券 19銘柄	100.0%	8.0%
タイバーツ	国債証券 19銘柄	100.0%	9.0%
フィリピンペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
インドネシアルピア	国債証券 27銘柄	100.0%	10.4%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	7.7%
香港・オフショア人民元	国債証券 23銘柄	100.0%	10.6%

(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。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,391,700,529
投資証券	106,369,691,280
派生商品評価勘定	70,318,800
未収入金	29,937,500
未収配当金	586,198,383
差入委託証拠金	195,534,000
流動資産合計	111,643,380,492
資産合計	111,643,380,492
負債の部	
流動負債	
前受金	70,318,800
未払金	1,254,834,438
未払解約金	60,834,516
未払利息	7,876
流動負債合計	1,385,995,630
負債合計	1,385,995,630
純資産の部	
元本等	
元本	49,268,603,738
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	60,988,781,124
元本等合計	110,257,384,862
純資産合計	110,257,384,862
負債純資産合計	111,643,380,492

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

	2021年 8月20日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	49,268,603,738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 2.2379円 (1万口当たり純資産額) (22,379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

	2021年 8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不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年 8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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月21日
期首元本額	67,393,999,603円
期中追加設定元本額	6,563,384,746円

区分	2021年 8月20日現在
期中一部解約元本額	24,688,780,611円
期末元本額	49,268,603,738円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,649,982,018円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,580,563円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	15,909,866,935円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	22,398,556,313円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,286,420,154円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,886,625,627円
分散投資コア戦略ファンドA	713,156,285円
分散投資コア戦略ファンドS	1,525,803,522円
コア投資戦略ファンド（切替型）	764,643,554円
S M T インデックスバランス・オープン	27,227,258円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	257,938,774円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,592,861円
グローバル経済コア	260,682,439円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,038,818円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	400,278,336円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	47,734,457円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	486,738,505円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	11,163,681円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	41,981,103円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	17,781円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	893,001,894円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	378,158,325円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	307,414,535円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	18,987,921,495
合計	18,987,921,495

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

(2021年 8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	不動産投信指数先物 取引 買建	3,807,313,200	-	3,877,632,000	70,318,800
合計		3,807,313,200	-	3,877,632,000	70,318,800

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,850	258,260,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	2,248	294,937,600	
	S O S i L A 物流リート投資法人	3,854	685,626,600	
	東海道リート投資法人	704	75,750,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,172	2,118,896,000	
	森ヒルズリート投資法人	10,802	1,728,320,000	
	産業ファンド投資法人	13,042	2,815,767,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	9,185	3,361,710,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,274	1,475,017,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	4,603	2,170,314,500	
	G L P 投資法人	29,752	5,944,449,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,136	1,439,328,000	
	日本プロロジスリート投資法人	14,554	5,588,736,000	
	星野リゾート・リート投資法人	1,417	979,147,000	
	O n e リート投資法人	1,432	484,732,000	
	イオンリート投資法人	10,804	1,631,404,000	
	ヒューリックリート投資法人	8,076	1,531,209,600	
	日本リート投資法人	2,835	1,251,652,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	23,478	532,011,480	

積水ハウス・リート投資法人	27,020	2,575,006,000	
トーセイ・リート投資法人	1,919	270,387,100	
ケネディクス商業リート投資法人	3,668	1,078,392,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,959	294,437,700	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,081	248,471,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	29,707	5,127,428,200	
いちごホテルリート投資法人	1,522	130,435,400	
ラサールロジポート投資法人	11,246	2,196,343,800	
スターアジア不動産投資法人	9,494	553,500,200	
マリモ地方創生リート投資法人	861	111,585,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,415	2,158,280,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,483	117,157,000	
投資法人みらい	10,472	565,488,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,155	278,857,000	
三菱地所物流リート投資法人	2,335	1,193,185,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	3,151	682,821,700	
ザイマックス・リート投資法人	1,333	158,760,300	
タカラレーベン不動産投資法人	2,914	352,011,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,582	582,791,400	
日本ビルファンド投資法人	10,411	7,370,988,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,186	6,145,434,000	
日本都市ファンド投資法人	46,350	4,936,275,000	
オリックス不動産投資法人	18,304	3,682,764,800	
日本プライムリアルティ投資法人	6,037	2,478,188,500	
NTT都市開発リート投資法人	8,297	1,286,864,700	
東急リアル・エステート投資法人	6,159	1,172,673,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,379	787,168,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	20,680	3,211,604,000	
森トラスト総合リート投資法人	6,565	1,001,162,500	
インヴィンシブル投資法人	40,433	1,593,060,200	
フロンティア不動産投資法人	3,220	1,534,330,000	
平和不動産リート投資法人	5,951	1,015,835,700	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,002	2,052,684,000	
福岡リート投資法人	4,751	850,904,100	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,842	2,228,128,000	
いちごオフィスリート投資法人	7,527	725,602,800	
大和証券オフィス投資法人	1,942	1,475,920,000	
阪急阪神リート投資法人	4,149	677,116,800	
スターツプロシード投資法人	1,431	371,058,300	
大和ハウスリート投資法人	13,107	4,312,203,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	28,143	1,722,351,600	
大和証券リビング投資法人	12,016	1,464,750,400	

ジャパンエクセレント投資法人	8,524	1,230,013,200	
合計	550,941	106,369,691,280	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2021年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	235,775,397
コール・ローン	67,969,847
投資証券	93,920,601,093
未収入金	4,702,183
未収配当金	189,040,864
流動資産合計	94,418,089,384
資産合計	94,418,089,384
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	42,688
未払解約金	8,728,829
未払利息	121
流動負債合計	8,771,638
負債合計	8,771,638
純資産の部	
元本等	
元本	41,353,395,001
剰余金	
剰余金又は欠損金()	53,055,922,745
元本等合計	94,409,317,746
純資産合計	94,409,317,746
負債純資産合計	94,418,089,384

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 8月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

2021年 8月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,353,395,001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 2.2830円 (1万口当たり純資産額) (22,830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

	2021年 8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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8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。

	2021年 8月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月21日
期首元本額	58,071,297,346円
期中追加設定元本額	5,932,043,697円
期中一部解約元本額	22,649,946,042円
期末元本額	41,353,395,001円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	68,825,047円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	108,282,995円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,681,586,786円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,766,538円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,906,297,496円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	18,306,735,346円
コア投資戦略ファンド（安定型）	856,900,086円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,876,449,955円
分散投資コア戦略ファンドA	692,328,368円
分散投資コア戦略ファンドS	1,482,716,195円

区分	2021年 8月20日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	716,396,594円
SMT インデックスバランス・オープン	151,225,173円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	255,657,000円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,993,415円
グローバル経済コア	263,538,660円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,402,652円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	408,099,388円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	46,712,445円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,299,395,745円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	408,665,382円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,540,429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）	3,392,209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）	12,981円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	117,496,637円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	120,314,866円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	116,232,884円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	115,423,480円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	112,555,727円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	112,450,522円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		18,790,533,892
合計		18,790,533,892

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 8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		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	50,590,800	-	50,548,112	42,688
	アメリカドル	50,590,800	-	50,548,112	42,688
合計		50,590,800	-	50,548,112	42,688

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,940	956,637.20	
		AGREE REALTY CORP	38,105	2,827,772.05	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	41,570	821,838.90	
		ALEXANDER'S INC	1,190	318,777.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	76,254	15,646,558.26	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,157	1,020,288.49	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	76,794	3,719,901.36	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	496,384.70	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	152,152	6,192,586.40	
		AMERICOLD REALTY TRUST	140,340	5,233,278.60	
		APARTMENT INCOME REIT CO	87,139	4,360,435.56	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	76,106	490,122.64	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	1,665,092.13	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	30,500	391,620.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	77,599	17,378,296.05	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	168,993.00	
		BOSTON PROPERTIES	78,945	8,910,522.15	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,254,508.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	164,985	3,703,913.25	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	2,253,289.06	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	91,800.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	54,356	7,988,157.76	
		CARETRUST REIT INC	52,477	1,122,483.03	
		CENTERSPACE	7,499	736,026.85	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,360	285,046.40	

CIM COMMERCIAL TRUST CORP	13,000	93,080.00	
CITY OFFICE REIT INC	25,050	322,393.50	
CLIPPER REALTY INC	7,300	56,137.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	66,331	1,130,280.24	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	13,843	659,065.23	
COREPOINT LODGING INC	22,000	294,360.00	
CORESITE REALTY CORP	24,029	3,504,389.36	
CORPORATE OFFICE PPTYS	63,159	1,793,715.60	
COUSINS PROPERTIES INC	82,626	3,170,359.62	
CTO REALTY GROWTH INC	2,800	148,540.00	
CUBESMART	111,990	5,711,490.00	
CYRUSONE INC	68,129	5,128,751.12	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	944,764.80	
DIGITAL REALTY TRUST INC	156,395	25,476,745.50	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	254,923	1,697,787.18	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	132,800	460,816.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,697	2,930,636.12	
DUKE REALTY CORP	208,231	10,538,570.91	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	1,036,779.00	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	22,299	3,896,081.28	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	828,214.78	
EPR PROPERTIES	41,912	1,978,665.52	
EQUINIX INC	49,756	41,494,513.76	
EQUITY COMMONWEALTH	67,845	1,780,252.80	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,169	7,842,394.32	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	191,046	15,738,369.48	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	61,664	1,870,885.76	
ESSEX PROPERTY TRUST	36,165	11,523,977.25	
EXTRA SPACE STORAGE INC	74,300	13,113,950.00	
FARMLAND PARTNERS INC	12,200	140,056.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,450	4,547,007.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	71,853	3,968,441.19	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	43,750	1,195,250.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	57,973	276,531.21	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	121,701	5,746,721.22	
GEO GROUP INC/THE	64,306	520,878.60	
GETTY REALTY CORP	21,985	681,095.30	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	451,964.50	
GLADSTONE LAND CORP	15,500	363,010.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	27,530	415,152.40	
GLOBAL NET LEASE INC	51,412	885,828.76	

HEALTHCARE REALTY TRUST INC	78,310	2,340,685.90	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	121,604	3,606,774.64	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	299,312	10,520,816.80	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	185,107.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	57,872	2,616,971.84	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	392,121	5,826,918.06	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	84,730	2,177,561.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	59,131	1,170,793.80	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,941	1,026,304.05	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	12,688	2,906,567.04	
INVITATION HOMES INC	315,231	12,678,590.82	
IRON MOUNTAIN INC	160,432	7,346,181.28	
JBG SMITH PROPERTIES	62,238	1,829,797.20	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	350,000	262,500.00	
KILROY REALTY CORPORATION	58,949	3,836,400.92	
KIMCO REALTY CORP	333,810	7,033,376.70	
KITE REALTY GROUP TRUST	46,370	868,510.10	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	152,908	2,045,909.04	
LIFE STORAGE INC	42,825	5,155,273.50	
LTC PROPERTIES INC	23,274	799,461.90	
MACERICH CO/THE	92,542	1,421,445.12	
MACK-CALI REALTY CORP	50,236	873,101.68	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	541,374.54	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	326,646	6,421,860.36	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,596	11,974,490.84	
MONMOUTH REIT -CL A	54,952	1,044,088.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	97,618	4,565,593.86	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	43,310	2,392,444.40	
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,482,526.90	
NETSTREIT CORP	14,992	384,694.72	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	45,000	381,600.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	746,437.25	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	728,032.80	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	130,739	4,280,394.86	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	262,785.44	
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	786,897.02	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	131,413	2,287,900.33	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	1,444,434.21	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	68,950.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,193,397.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,236,216.80	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	357,750.00	

PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	346,776.30	
PRIME US REIT	295,000	249,275.00	
PROLOGIS INC	410,939	54,716,527.85	
PS BUSINESS PARKS INC	11,172	1,699,819.80	
PUBLIC STORAGE	84,567	27,270,320.49	
QTS REALTY TRUST INC	38,049	2,956,407.30	
REALTY INCOME CORP	207,447	14,840,758.38	
REGENCY CENTERS CORP	87,860	5,658,184.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	69,195	1,181,850.60	
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	115,918	1,414,199.60	
RETAIL VALUE	9,529	244,514.14	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	74,605	4,562,095.75	
RLJ LODGING TRUST	92,291	1,247,774.32	
RPT REALTY	43,950	534,432.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,696	2,233,134.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,636	1,842,417.08	
SAFEHOLD INC	8,340	740,175.00	
SAUL CENTERS INC	6,800	309,468.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	283,575.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	94,169	994,424.64	
SIMON PROPERTY GROUP	182,555	23,451,015.30	
SITE CENTERS CORP	91,820	1,406,682.40	
SL GREEN REALTY CORP	38,655	2,725,564.05	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63,982	3,152,393.14	
STAG INDUSTRIAL INC	88,769	3,711,431.89	
STORE CAPITAL CORP	135,277	4,740,106.08	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	63,470	538,225.60	
SUN COMMUNITIES INC	62,166	12,277,163.34	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	116,130	1,240,268.40	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	57,370	920,788.50	
TERRENO REALTY CORP	38,649	2,560,109.76	
UDR INC	164,937	8,741,661.00	
UMH PROPERTIES INC	21,320	485,882.80	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	410,779.43	
URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,083,883.50	
URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	282,789.50	
VENTAS INC	208,364	11,370,423.48	
VEREIT INC	127,297	6,352,120.30	
VICI PROPERTIES INC	298,370	8,733,289.90	
VORNADO REALTY TRUST	87,169	3,562,597.03	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,107,806.70	

	WELLTOWER INC	231,891	19,497,395.28	
	WHITESTONE REIT	19,090	177,918.80	
	WP CAREY INC	98,844	7,624,826.16	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	1,014,783.00	
	アメリカドル 小計	13,907,057	643,039,599.16 (70,663,621,551)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	1,449,323.40	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	40,330	462,585.10	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	153,960.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,360	521,424.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	47,920	2,851,240.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,288,241.50	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	47,120	508,896.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	480,512.16	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	484,443.10	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	51,250	845,625.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	304,040.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	1,002,312.15	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,605	1,657,891.55	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	74,039	1,166,854.64	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	590,097.90	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	629,536.50	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	267,399.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	232,020.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	48,470	625,263.00	
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	112,750.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	83,631	1,813,956.39	
	SLATE GROCERY REIT	10,300	137,917.00	
	SLATE OFFICE REI	17,000	90,950.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	41,476	1,238,058.60	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	1,005,330.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	193,500.00	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	23,500	655,180.00	
	カナダドル 小計	958,475	20,769,306.99 (1,780,760,381)	
ユーロ	AEDIFICA	19,919	2,430,118.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	99,700	1,784,630.00	

	ALTAREA	2,230	437,080.00	
	BEFIMMO S.C.A.	14,010	497,355.00	
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	420,000.00	
	CARMILA	25,000	294,500.00	
	COFINIMMO	16,367	2,294,653.40	
	COVIVIO(FP)	26,953	2,127,130.76	
	CROMWELL REIT EUR	160,000	403,200.00	
	EUROCOMMERCIAL	20,783	451,822.42	
	GECINA SA	30,262	4,009,715.00	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	371,110.00	
	HIBERNIA REIT PLC	365,550	478,139.40	
	ICADE	17,080	1,263,920.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	133,977.35	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	143,462	1,334,196.60	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	307,340.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	408,200.00	
	KLEPIERRE	111,985	2,275,535.20	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	185,980.00	
	MERCIALYS	19,000	188,385.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	177,486	1,743,622.46	
	MONTEA NV	5,300	626,460.00	
	NSI NV	10,050	359,287.50	
	RETAIL ESTATES	6,400	441,600.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	77,071	5,652,387.14	
	VASTNED RETAIL	10,650	256,132.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	75,722	2,924,383.64	
	WERELDHAVE NV	22,670	307,405.20	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	556,452.00	
	ユーロ 小計	1,859,980	34,964,718.57 (4,488,770,570)	
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	118,000	124,844.00	
	ASSURA PLC	1,467,040	1,132,554.88	
	BIG YELLOW GROUP PLC	88,646	1,352,737.96	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	435,870.00	
	BRITISH LAND CO PLC	527,668	2,715,379.52	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	470,297	796,683.11	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	367,694.63	
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	239,430.07	
	DERWENT LONDON PLC	62,782	2,322,934.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	301,104.00	
	GCP STUDENT LIVING PLC	233,000	496,290.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	136,780	1,056,625.50	

	HAMMERSON PLC	2,291,000	746,178.70	
	HOME REIT PLC	132,934	152,874.10	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	203,603.54	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	422,451	2,999,402.10	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	497,660	1,289,934.72	
	LXI REIT PLC	344,008	493,307.47	
	NEWRIVER REIT PL	186,000	149,730.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	317,130.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	728,888	1,208,496.30	
	REGIONAL REIT LTD	222,000	195,804.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	116,037	1,299,614.40	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	178,150.00	
	SEGR0 PLC	668,947	8,542,453.19	
	SHAFTESBURY PLC	160,193	990,793.70	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	190,612.63	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	466,000	569,685.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	226,867.17	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	971,658	2,258,133.19	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	392,000	314,776.00	
	UNITE GROUP PLC	220,572	2,686,566.96	
	WORKSPACE GROUP PLC	70,347	679,552.02	
	イギリスポンド 小計	14,143,608	37,045,082.86 (5,553,057,920)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	232,716	774,944.28	
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	260,250.00	
	ARENA REIT	201,053	816,275.18	
	AVENTUS GROUP	193,500	632,745.00	
	BWP TRUST	262,160	1,064,369.60	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	321,000	1,072,140.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	266,606	1,047,761.58	
	CENTURIA OFFICE REIT	220,945	556,781.40	
	CHARTER HALL GROUP	259,369	4,393,710.86	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	294,312	1,521,593.04	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	296,160	1,113,561.60	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	687,340.50	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,102,633	986,856.53	
	DEXUS	598,428	6,331,368.24	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	373,175.00	
	GOODMAN GROUP	934,143	21,046,241.79	
	GPT GROUP	1,072,455	5,061,987.60	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	678,713.20	
	HOME CONSORTIUM	91,000	534,170.00	

	HOMECO DAILY NEEDS REIT	268,642	396,246.95	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	82,885	276,007.05	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	156,788	976,789.24	
	IRONGATE GROUP	272,000	424,320.00	
	MIRVAC GROUP	2,190,726	6,725,528.82	
	NATIONAL STORAGE REIT	601,340	1,353,015.00	
	RURAL FUNDS GROUP	238,095	614,285.10	
	SCENTRE GROUP	2,886,991	7,361,827.05	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	585,060	1,562,110.20	
	STOCKLAND	1,328,376	6,044,110.80	
	VICINITY CENTERS	2,156,333	3,385,442.81	
	WAYPOINT REIT LTD	415,796	1,155,912.88	
	オーストラリアドル 小計	18,285,122	79,229,581.30 (6,227,445,090)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	502,278	808,667.58	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	600,300	1,551,775.50	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	1,004,433.30	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	1,140,432.98	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	731,467.97	
	ニュージーランドドル 小計	2,867,311	5,236,777.33 (393,177,241)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,138,000	4,984,440.00	
	FORTUNE REIT	756,000	6,652,800.00	
	LINK REIT	1,159,400	84,520,260.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,308,640.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,782,560.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	818,000	3,321,080.00	
	香港ドル 小計	5,184,400	104,569,780.00 (1,475,479,595)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	409,750.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	744,977	670,479.30	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,837,318	5,677,312.62	
	ASCOTT TRUST	991,877	1,001,795.77	
	CAPITALAND CHINA TRUST	507,721	660,037.30	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,540,044	5,308,691.96	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	488,124.00	
	EC WORLD REIT	180,000	146,700.00	
	ESR REIT	1,448,995	695,517.60	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	313,200.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	139,906.00	

	FRASERS CENTREPOINT TRUST	734,262	1,696,145.22	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	234,600.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,610,096	2,431,244.96	
	IREIT GLOBAL	405,985	259,830.40	
	KEPPEL DC REIT	660,003	1,683,007.65	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,177,568.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	555,000	488,400.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,480,400	153,784.80	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,240,473	2,567,779.11	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,088,963	3,168,882.33	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,640,700	3,396,249.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,092,100	1,092,100.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,273,644	515,825.82	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	225,500	1,095,930.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	478,540	212,950.30	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	275,094.00	
	SPH REIT	576,800	513,352.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	859,400	524,234.00	
	SUNTEC REIT	1,180,700	1,712,015.00	
	シンガポールドル 小計	27,930,998	38,710,507.14	(3,119,292,665)
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	54,685	363,108,400.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	62,791,740.00	
	JR REIT XXVII	64,338	339,061,260.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	119,200,000.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	418,209,600.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	199,502,750.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	154,844,230.00	
	韓国ウォン 小計	284,799	1,656,717,980.00	(155,731,490)
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	1,870,245.00	
	イスラエルシェケル 小計	103,500	1,870,245.00	(63,264,590)
	合計	85,525,250	93,920,601,093	(93,920,601,093)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

- 通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。
- 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 154銘柄	100.0%	75.2%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 30銘柄	100.0%	4.8%
イギリスポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.9%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.6%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	3.3%
韓国ウォン	投資証券 7銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 1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。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

項目	2021年 8月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	69,572,173
コール・ローン	37,325,964
投資信託受益証券	28,017,438,735
未収入金	19,265,850
流動資産合計	28,143,602,722
資産合計	28,143,602,722
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	69,501,611
未払金	36,782,482
未払利息	66
流動負債合計	106,284,159
負債合計	106,284,159
純資産の部	
元本等	
元本	22,548,739,794

	2021年 8月20日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,488,578,769
元本等合計	28,037,318,563
純資産合計	28,037,318,563
負債純資産合計	28,143,602,722

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,548,739,794口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.2434円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (12,434円)</p>

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2021年 8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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理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管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2021年 8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。

	2021年 8月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 8月21日
期首元本額	22,711,024,127円
期中追加設定元本額	10,001,091,642円
期中一部解約元本額	10,163,375,975円
期末元本額	22,548,739,794円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,248,503,799円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,329,169,406円
分散投資コア戦略ファンドA	1,900,880,848円
分散投資コア戦略ファンドS	6,725,988,548円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,376,230,479円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	531,632,248円
グローバル経済コア	1,188,487,336円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,277,371,350円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	589,456,362円

区分	2021年 8月20日現在
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	70,829,371円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	155,667,880円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	2,154,502,753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）	19,414円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	421,466,691	
合計	421,466,691	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 8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		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	27,995,240,936	-	28,064,742,547	69,501,611
	アメリカドル	27,995,240,936	-	28,064,742,547	69,501,611
合計		27,995,240,936	-	28,064,742,547	69,501,611

（注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	7,518,695	254,958,947.45	
	アメリカドル 小計		7,518,695	254,958,947.45 (28,017,438,735)	
合計			7,518,695	28,017,438,735 (28,017,438,735)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期中間計算期間(2021年8月21日から2022年2月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【グローバル経済コア】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2021年 8月20日現在)	第5期中間計算期間 (2022年 2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	125,888,410	99,563,793
親投資信託受益証券	10,651,006,807	10,546,228,450
未収入金	-	68,978,848
流動資産合計	10,776,895,217	10,714,771,091
資産合計	10,776,895,217	10,714,771,091
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,650,237	12,880,984
未払受託者報酬	2,949,977	3,016,344
未払委託者報酬	47,199,550	48,261,468
未払利息	225	337
その他未払費用	294,936	301,571
流動負債合計	60,094,925	64,460,704
負債合計	60,094,925	64,460,704
純資産の部		
元本等		
元本	8,726,658,020	8,538,910,884
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	1,990,142,272	2,111,399,503
(分配準備積立金)	1,692,183,910	1,539,784,478
元本等合計	10,716,800,292	10,650,310,387
純資産合計	10,716,800,292	10,650,310,387
負債純資産合計	10,776,895,217	10,714,771,091

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自 2020年 8月21日 至 2021年 2月20日	第5期中間計算期間 自 2021年 8月21日 至 2022年 2月20日
営業収益		
受取利息	403	424
有価証券売買等損益	888,650,320	224,231,921
営業収益合計	888,650,723	224,232,345
営業費用		
支払利息	26,271	24,392
受託者報酬	2,963,531	3,016,344
委託者報酬	47,416,348	48,261,468
その他費用	296,290	301,571
営業費用合計	50,702,440	51,603,775
営業利益又は営業損失（ ）	837,948,283	172,628,570
経常利益又は経常損失（ ）	837,948,283	172,628,570
中間純利益又は中間純損失（ ）	837,948,283	172,628,570
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	50,610,005	26,097,289
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	893,559,744	1,990,142,272
剰余金増加額又は欠損金減少額	63,059,686	161,742,431
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	63,059,686	161,742,431
剰余金減少額又は欠損金増加額	145,171,523	187,016,481
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	145,171,523	187,016,481
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,598,786,185	2,111,399,503

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第4期 (2021年 8月20日現在)	第5期中間計算期間 (2022年 2月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,726,658,020口	8,538,910,884口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2281円 (12,281円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2473円 (12,473円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第5期中間計算期間 (2022年 2月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第5期中間計算期間 (2022年 2月20日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第4期 自 2020年 8月21日 至 2021年 8月20日	第5期中間計算期間 自 2021年 8月21日 至 2022年 2月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	10,151,427,698円	8,726,658,020円
期中追加設定元本額	1,307,931,638円	632,610,776円
期中一部解約元本額	2,732,701,316円	820,357,912円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,728,943,011
株式	472,203,665,960

項目	2022年 2月20日現在
	金額（円）
派生商品評価勘定	18,786,500
未収配当金	742,989,291
前払金	41,431,300
差入委託証拠金	127,115,000
流動資産合計	475,862,931,062
資産合計	475,862,931,062
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	60,261,800
未払解約金	95,197,633
未払利息	3,087
流動負債合計	155,462,520
負債合計	155,462,520
純資産の部	
元本等	
元本	253,411,178,326
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	222,296,290,216
元本等合計	475,707,468,542
純資産合計	475,707,468,542
負債純資産合計	475,862,931,062

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 2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 2月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		253,411,178,326口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8772円 (18,772円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2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。

（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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	252,388,145,127円
期中追加設定元本額	13,604,900,473円
期中一部解約元本額	12,581,867,274円
期末元本額	253,411,178,326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）	406,773,315円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,934,955,955円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,811,302円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,332,915,330円
世界経済インデックスファンド	3,574,199,562円
日本株式インデックス・オープン	3,372,083,431円
DCマイセクション25	6,124,268,831円
DCマイセクション50	18,391,759,016円
DCマイセクション75	18,485,431,395円
DC日本株式インデックス・オープン	6,066,539,404円
DCマイセクションS25	3,023,057,573円
DCマイセクションS50	8,875,170,351円
DCマイセクションS75	6,559,646,279円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,048,170,967円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	223,630,312円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	703,045,444円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	506,322,071円
DC世界経済インデックスファンド	3,468,428,986円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,600,100,694円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	5,445,200円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	19,069,354円
マイセクション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）	190,283,657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）	32,086,056円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	119,535,189円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	25,775,239円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	76,065,012円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	959,617,477円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	442,697,010円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,887,604,052円

区分	2022年 2月20日現在
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	68,494,009円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	26,309,071円
バランスD（35）V A 1（適格機関投資家専用）	507,745,829円
バランスE（25）V A 1（適格機関投資家専用）	280,793,456円
バランスF（25）V A 1（適格機関投資家専用）	362,761,620円
国内バランス25V A 1（適格機関投資家専用）	37,133,693円
F O F s用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	594,002,548円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,360,498,643円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,897,745,246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	5,837,881,242円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	452,071,032円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	409,824,667円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,816,992,074円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	217,178,058円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,792,435円
S M T インデックスバランス・オープン	58,133,956円
国内株式S M T Bセクション（S M A専用）	24,628,900,927円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	551,200,014円
S M T 世界経済インデックス・オープン	42,725,091円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	155,837,399円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	29,220,070円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	7,521,199円
グローバル経済コア	215,047,826円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	25,947,110円
i - S M T T O P I Xインデックス（ノーロード）	96,887,745円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	21,256,129円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	755,085,424円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	178,527,711円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	7,195,625円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	5,025,508円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2,537,975円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,164,020円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	43,476,972,331円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,049,947,278円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	259,583,542円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	49,925,207円
S M T A M日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	47,733,735,059円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	11,109,569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）	241,342,793円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 2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	株価指数先物取引 買建	3,383,971,300	-	3,342,540,000	41,431,300
合計		3,383,971,300	-	3,342,540,000	41,431,300

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2022年 2月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	286,642,616
国債証券	515,725,437,500
地方債証券	34,127,257,797
特殊債券	37,141,675,714
社債券	29,959,119,180
未収入金	596,290,300
未収利息	1,341,889,098
前払費用	16,405,162
流動資産合計	619,194,717,367
資産合計	619,194,717,367
負債の部	
流動負債	
未払金	300,000,000
未払解約金	252,463,780
未払利息	324
流動負債合計	552,464,104
負債合計	552,464,104
純資産の部	
元本等	
元本	446,283,567,433
剰余金	
剰余金又は欠損金()	172,358,685,830
元本等合計	618,642,253,263
純資産合計	618,642,253,263
負債純資産合計	619,194,717,367

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	446,283,567,433口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 100,181,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3862円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,862円)</p>

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2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

	2022年 2月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、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。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	463,227,658,646円
期中追加設定元本額	23,966,755,524円
期中一部解約元本額	40,910,846,737円
期末元本額	446,283,567,433円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,938,644,868円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,195,947円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,155,957,444円
世界経済インデックスファンド	3,418,024,448円
D C マイセレクション 2 5	25,307,278,475円
D C マイセレクション 5 0	28,621,333,070円
D C マイセレクション 7 5	8,452,955,094円
D C 日本債券インデックス・オープン	442,255,104円
D C 日本債券インデックス・オープン S	92,919,311,412円
D C 日本債券インデックス・オープン P	67,784,193,859円

区分	2022年 2月20日現在
DCマイセレクションS25	12,290,934,694円
DCマイセレクションS50	13,666,720,196円
DCマイセレクションS75	2,971,165,731円
DCターゲット・イヤーフンド2025	885,583,930円
DCターゲット・イヤーフンド2035	2,090,133,430円
DCターゲット・イヤーフンド2045	767,601,004円
DC世界経済インデックスファンド	3,208,653,406円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	8,505,960円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,380,529円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	28,594,988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)	95,192,245円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	135,313,801円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	32,328,406円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	27,844,268円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,081,906,142円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	774,735,581円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,270,252,089円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	107,388,459円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	75,590,655円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,048,961,504円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,159,367,545円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,475,363,223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	5,533,333,274円
日本債券ファンド・シリーズ1	14,981,698,117円
分散投資コア戦略ファンドA	19,373,272,084円
分散投資コア戦略ファンドS	24,355,633,293円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	148,968,894円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,319,190,285円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	64,757,476円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	35,859,940円
SMT インデックスバランス・オープン	61,563,122円
SMT 世界経済インデックス・オープン	33,080,551円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	63,576,767円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	104,843,135円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,530,156円
グローバル経済コア	226,850,291円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	27,724,762円
DCターゲット・イヤーフンド2055	15,357,001円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	11,642,936円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	5,267,223円

区分	2022年 2月20日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,718,418円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,290,904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）	81,046,326,328円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	83,816,246円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	10,294,209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）	349,054,254円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,778,539,916
コール・ローン	8,380,251,352
株式	477,260,897,946
投資信託受益証券	209,598,567
投資証券	10,781,436,823
派生商品評価勘定	25,058,308
未収入金	81,841,645
未収配当金	420,804,641
前払金	418,662,074
差入委託証拠金	1,079,488,773
流動資産合計	508,436,580,045
資産合計	508,436,580,045
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	444,690,988
未払解約金	8,093,025,004
未払利息	9,482
流動負債合計	8,537,725,474
負債合計	8,537,725,474
純資産の部	
元本等	
元本	124,026,254,406
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	375,872,600,165
元本等合計	499,898,854,571
純資産合計	499,898,854,571
負債純資産合計	508,436,580,045

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	2022年 2月20日現在
	<p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	124,026,254,406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 4.0306円 (1万口当たり純資産額) (40,306円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2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ぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

2022年 2月20日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	133,932,817,817円
期中追加設定元本額	6,886,522,220円
期中一部解約元本額	16,793,085,631円
期末元本額	124,026,254,406円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,887,195,665円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,140,691円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	30,600,826,997円
世界経済インデックスファンド	9,812,439,772円
外国株式インデックス・オープン	846,885,830円
D C マイセレクション 2 5	823,304,974円
D C マイセレクション 5 0	3,829,271,586円
D C マイセレクション 7 5	4,418,187,526円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,712,259,511円
D C マイセレクション S 2 5	399,182,468円
D C マイセレクション S 5 0	1,818,697,674円
D C マイセレクション S 7 5	1,542,076,448円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	52,422,263円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	166,057,692円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	119,556,740円
D C 世界経済インデックスファンド	9,551,121,941円

区分	2022年 2月20日現在
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,468,475,868円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,831,300円
マイセクション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）	30,765,348円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	15,783,546円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	56,114,603円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	11,848,771円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	34,972,916円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	310,043,074円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	185,047,740円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,354,220,916円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	157,984,586円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	36,361,026円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	180,165,447円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	60,255,657円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,102,480,578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）	1,193,078,233円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,152,979,872円
コア投資戦略ファンド（安定型）	721,771,604円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,549,904,973円
分散投資コア戦略ファンドA	1,477,970,855円
分散投資コア戦略ファンドS	8,169,385,937円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,247,537,033円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,072,476,294円
コア投資戦略ファンド（切替型）	592,582,232円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	600,838,036円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,319,395円
SMT インデックスバランス・オープン	159,146,290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セクション（SMA専用）	15,716,495,282円
SMT 世界経済インデックス・オープン	179,044,421円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	665,747,556円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	128,631,460円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,827,912円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	153,099,343円
グローバル経済コア	634,875,833円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,809,488円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,015,160円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	238,103,886円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	66,889,150円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	20,178,399円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	14,045,508円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	7,044,857円

区分	2022年 2月20日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	8,962,708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）	338,304,267円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	516,607,898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）	1,061,224,794円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,119,940,185円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	211,469,782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）	47,381,017円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	84,594,406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）	193,854,892円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 2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	株価指数先物取引 買建	12,201,355,654	-	11,782,693,580	418,662,074
合計		12,201,355,654	-	11,782,693,580	418,662,074

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2022年 2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		
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	510,166,402	-	509,195,796	970,606
	アメリカドル	510,166,402	-	509,195,796	970,606
	合計	510,166,402	-	509,195,796	970,606

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	460,576,299
コール・ローン	4,594,310,154
国債証券	296,747,361,229
派生商品評価勘定	1,344,213
未収入金	289,603
未収利息	1,536,964,991
前払金	55,268,410
前払費用	81,030,375
差入委託証拠金	327,638,724
流動資産合計	303,804,783,998
資産合計	303,804,783,998
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	85,200,596
未払金	1,130,124
未払解約金	748,444,152
未払利息	5,198
流動負債合計	834,780,070
負債合計	834,780,070
純資産の部	
元本等	
元本	100,424,388,514
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	202,545,615,414
元本等合計	302,970,003,928
純資産合計	302,970,003,928
負債純資産合計	303,804,783,998

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	100,424,388,514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 3.0169円 (1万口当たり純資産額) (30,169円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	96,318,492,637円
期中追加設定元本額	8,060,437,582円
期中一部解約元本額	3,954,541,705円
期末元本額	100,424,388,514円
期末元本額の内訳	

区分	2022年 2月20日現在
外国債券オープン（毎月決算型）	1,347,771,219円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	580,899,833円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,141,620,988円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,624,263円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,037,997,355円
世界経済インデックスファンド	12,715,585,213円
D C マイセレクション 2 5	1,922,629,586円
D C マイセレクション 5 0	1,632,487,142円
D C マイセレクション 7 5	1,144,191,207円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,274,181,264円
D C マイセレクション S 2 5	911,886,254円
D C マイセレクション S 5 0	719,483,031円
D C マイセレクション S 7 5	398,362,101円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	33,925,314円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	88,813,250円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	45,165,356円
D C 世界経済インデックスファンド	12,224,569,089円
外国債券インデックス・オープン（S M A 専用）	651,432,486円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,650,011円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,288,528円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	26,886,383円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	49,031,563円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	76,013,991円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	73,878,160円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	72,744,179円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,375,650,459円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	454,119,167円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,804,228,508円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	102,220,610円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	54,985,436円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	470,402,947円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	170,711,416円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	218,620,740円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	753,600,718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）	2,039,333,438円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	687,759,613円
外国債券ファンド・シリーズ 1	667,926,226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
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	515,612,721円

区分	2022年 2月20日現在
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,901,936,323円
コア投資戦略ファンド（切替型）	623,474,394円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	246,395,223円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	106,732,397円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,403,126,073円
S M T インデックスバランス・オープン	196,379,064円
外国債券S M T Bセクション（S M A専用）	19,118,866,632円
S M T 世界経済インデックス・オープン	229,759,508円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	278,204,061円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	462,519,637円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	4,340,579円
グローバル経済コア	832,617,635円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	15,026,610円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	1,467,792円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	212,025,684円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	32,523,960円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 3 0	7,447,199円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 4 0	6,421,293円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 5 0	3,615,549円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2 0 6 0	4,988,042円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	374,243,567円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	10,987,398,323円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	334,254,302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）	335,984,769円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	343,553,528円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	63,260,675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）	86,265,849円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2022年 2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	3,951,739,209	-	3,896,470,799	55,268,410
	合計	3,951,739,209	-	3,896,470,799	55,268,410

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2022年 2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		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,975,843,981	-	3,947,256,008	28,587,973
	アメリカドル	1,987,416,222	-	1,976,525,960	10,890,262
	カナダドル	153,004,542	-	151,828,824	1,175,718
	ユーロ	1,591,581,979	-	1,574,997,408	16,584,571
	イギリスポンド	243,841,238	-	243,903,816	62,578
合計		3,975,843,981	-	3,947,256,008	28,587,973

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,282,534,864
コール・ローン	56,794,306
株式	98,847,645,001
投資信託受益証券	211,082,328
投資証券	93,193,851
派生商品評価勘定	122,216,535
未収入金	6,244,478
未収配当金	141,330,759
差入委託証拠金	1,105,276,052
流動資産合計	107,866,318,174
資産合計	107,866,318,174
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,004,154
前受金	120,211,261
未払金	15,284
未払株式払込金	9,708,490

	2022年 2月20日現在
項目	金額（円）
未払解約金	41,459,831
未払利息	64
流動負債合計	173,399,084
負債合計	173,399,084
純資産の部	
元本等	
元本	29,109,514,336
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	78,583,404,754
元本等合計	107,692,919,090
純資産合計	107,692,919,090
負債純資産合計	107,866,318,174

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2022年 2月20日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	29,109,514,336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 3.6996円 (1万口当たり純資産額) (36,996円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 2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。

	2022年 2月20日現在
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	27,055,872,743円
期中追加設定元本額	2,617,461,151円
期中一部解約元本額	563,819,558円
期末元本額	29,109,514,336円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,667,211,999円
世界経済インデックスファンド	5,373,759,306円
D C 新興国株式インデックス・オープン	5,190,477,655円
D C 世界経済インデックスファンド	5,128,542,452円
新興国株式インデックス・オープン (S M A 専用)	185,899,281円

区分	2022年 2月20日現在
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）	693,225,162円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	585,277,623円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	330,782,968円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	16,190,108円
SMT インデックスバランス・オープン	81,702,675円
SMT 世界経済インデックス・オープン	144,060,388円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	548,351,100円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	98,075,673円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,797,626円
グローバル経済コア	348,280,898円
i-SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	39,748,087円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	11,252,191円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	7,835,800円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	3,937,510円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	4,961,257円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	911,624,505円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	168,567,717円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	39,614,081円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	11,072,031円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 2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	株価指数先物取引 買建	8,444,331,605	-	8,564,542,866	120,211,261
	合計	8,444,331,605	-	8,564,542,866	120,211,261

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2022年 2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		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	45,975,440	-	45,976,560	1,120
	アメリカドル	45,975,440	-	45,976,560	1,120
合計		45,975,440	-	45,976,560	1,120

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	823,437,539
コール・ローン	658,329,565
国債証券	82,808,931,730
派生商品評価勘定	42,651
未収利息	1,142,467,567
前払費用	151,005,368
流動資産合計	85,584,214,420
資産合計	85,584,214,420
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	97,492
未払解約金	203,252,769
未払利息	744
流動負債合計	203,351,005
負債合計	203,351,005
純資産の部	
元本等	
元本	47,743,642,442
剰余金	
剰余金又は欠損金()	37,637,220,973
元本等合計	85,380,863,415
純資産合計	85,380,863,415
負債純資産合計	85,584,214,420

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,743,642,442口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7883円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (17,883円)</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2022年 2月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p>

	2022年 2月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	42,682,968,944円
期中追加設定元本額	5,866,631,174円
期中一部解約元本額	805,957,676円
期末元本額	47,743,642,442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	5,115,925,340円
世界経済インデックスファンド	11,204,186,379円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,037,117,877円
DC世界経済インデックスファンド	10,409,700,389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)	1,801,150,172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

区分	2022年 2月20日現在
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	73,062,122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）	427,414,194円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,320,916,015円
コア投資戦略ファンド（切替型）	132,195,591円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	203,643,045円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	92,081,415円
SMT インデックスバランス・オープン	165,334,442円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	4,037,578,045円
SMT 世界経済インデックス・オープン	300,641,080円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	362,814,258円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	603,755,983円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,519,970円
グローバル経済コア	726,697,388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	11,949,495円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	7,699,011円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	3,683,366円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	4,437,887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）	78,680,513円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	443,580,979円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	82,772,348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）	16,987,672円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	303,552,927円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	299,172,955円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	290,446,321円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	288,701,336円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	292,549,609円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	288,010,650円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 2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		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	5,724,158	-	5,626,666	97,492
	アメリカドル	5,724,158	-	5,626,666	97,492

	売建	5,724,158	-	5,681,507	42,651
	ロシアルーブル	5,724,158	-	5,681,507	42,651
	合計	11,448,316	-	11,308,173	54,841

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

J - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,065,954,792
投資証券	104,011,848,895
未収入金	21,285,861
未収配当金	667,431,598
前払金	230,582,000
差入委託証拠金	218,174,000
流動資産合計	108,215,277,146
資産合計	108,215,277,146
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	230,582,000
未払金	16,851,120
未払解約金	23,839,695
未払利息	3,469
流動負債合計	271,276,284
負債合計	271,276,284
純資産の部	
元本等	
元本	52,775,229,725
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	55,168,771,137
元本等合計	107,944,000,862
純資産合計	107,944,000,862
負債純資産合計	108,215,277,146

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

2022年 2月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2022年 2月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	52,775,229,725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 2.0454円 (1万口当たり純資産額) (20,454円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2022年 2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	<p>(1)有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p>

	2022年 2月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	49,268,603,738円
期中追加設定元本額	6,241,192,434円
期中一部解約元本額	2,734,566,447円
期末元本額	52,775,229,725円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,673,829,089円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,902,276円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,513,434,828円
J リートインデックス・オープン（SMA専用）	24,918,713,567円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,311,353,253円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,959,775,127円
分散投資コア戦略ファンドA	795,726,284円
分散投資コア戦略ファンドS	1,687,481,776円
コア投資戦略ファンド（切替型）	791,804,026円

区分	2022年 2月20日現在
SMT インデックスバランス・オープン	26,458,903円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	260,548,498円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,609,025円
グローバル経済コア	238,553,785円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,243,026円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	398,473,908円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	64,650,712円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	491,004,788円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	18,925,480円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	75,117,190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）	78,700,205円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	878,044,369円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	265,602,788円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	302,276,822円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2022年 2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	不動産投信指数先物 取引 買建	4,149,442,000	-	3,918,860,000	230,582,000
	合計	4,149,442,000	-	3,918,860,000	230,582,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	414,948,364
コール・ローン	59,885,718
投資証券	93,331,472,683
派生商品評価勘定	1,361

	2022年 2月20日現在
項目	金額（円）
未収入金	4,740,213
未収配当金	133,099,498
流動資産合計	93,944,147,837
資産合計	93,944,147,837
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	147,196
未払解約金	20,853,946
未払利息	67
流動負債合計	21,001,209
負債合計	21,001,209
純資産の部	
元本等	
元本	38,873,353,910
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	55,049,792,718
元本等合計	93,923,146,628
純資産合計	93,923,146,628
負債純資産合計	93,944,147,837

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	2022年 2月20日現在
	<p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	38,873,353,910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 2.4161円 (1万口当たり純資産額) (24,161円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 8月21日
期首元本額	41,353,395,001円
期中追加設定元本額	3,185,104,214円
期中一部解約元本額	5,665,145,305円
期末元本額	38,873,353,910円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	61,766,844円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	97,873,344円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,696,883,356円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,881,073円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,959,512,187円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	16,646,334,074円
コア投資戦略ファンド（安定型）	709,208,254円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,597,861,481円
分散投資コア戦略ファンドA	647,769,269円
分散投資コア戦略ファンドS	1,393,496,043円
コア投資戦略ファンド（切替型）	600,833,516円
SMT インデックスバランス・オープン	139,537,154円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	214,485,652円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,448,547円
グローバル経済コア	231,711,468円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,473,927円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	235,263,379円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	54,358,377円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,164,721,359円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	342,652,896円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	156,722,038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）	80,780,294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）	49,129,754円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	104,725,440円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	109,950,868円

区分	2022年 2月20日現在
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	106,743,611円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	106,102,447円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	100,929,508円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	99,363,358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）	140,834,392円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 2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		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	65,306,170	-	65,160,335	145,835
	アメリカドル	44,974,846	-	44,827,958	146,888
	イギリスポンド	20,331,324	-	20,332,377	1,053
合計		65,306,170	-	65,160,335	145,835

（注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2022年 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	32,154,850
コール・ローン	61,684,315
投資信託受益証券	28,150,265,223
派生商品評価勘定	47,748,303
流動資産合計	28,291,852,691
資産合計	28,291,852,691
負債の部	
流動負債	
未払解約金	17,502,030
未払利息	69
流動負債合計	17,502,099

	2022年 2月20日現在
項目	金額（円）
負債合計	17,502,099
純資産の部	
元本等	
元本	21,395,584,279
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,878,766,313
元本等合計	28,274,350,592
純資産合計	28,274,350,592
負債純資産合計	28,291,852,691

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2022年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		21,395,584,279口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3215円 (13,215円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2022年 2月20日現在
期首	2021年 8月21日
期首元本額	22,548,739,794円
期中追加設定元本額	1,542,497,439円
期中一部解約元本額	2,695,652,954円
期末元本額	21,395,584,279円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,210,009,688円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,275,277,651円
分散投資コア戦略ファンドA	1,942,701,798円
分散投資コア戦略ファンドS	7,022,243,579円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,376,776,538円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	501,509,930円
グローバル経済コア	848,579,030円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,571,570,290円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	678,991,983円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	89,182,469円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	250,280,871円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	549,130,927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）	79,329,525円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2022年 2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		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	27,174,354,628	-	27,126,606,325	47,748,303
	アメリカドル	27,174,354,628	-	27,126,606,325	47,748,303
	合計	27,174,354,628	-	27,126,606,325	47,748,303

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【グローバル経済コア】

【純資産額計算書】

(2022年 3月31日現在)

資産総額	11,142,175,015円
負債総額	27,721,115円
純資産総額（ - ）	11,114,453,900円
発行済口数	8,568,408,383口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2971円
（1万口当たり純資産額）	（12,971円）

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 3月31日現在)

資産総額	495,706,283,548円
負債総額	3,598,591,204円
純資産総額（ - ）	492,107,692,344円
発行済口数	256,238,599,722口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9205円
（1万口当たり純資産額）	（19,205円）

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 3月31日現在)

資産総額	627,135,188,530円
負債総額	4,878,393,407円
純資産総額（ - ）	622,256,795,123円
発行済口数	448,301,913,541口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3880円
（1万口当たり純資産額）	（13,880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 3月31日現在)

資産総額	555,085,613,017円
負債総額	1,343,929,109円
純資産総額（ - ）	553,741,683,908円
発行済口数	124,518,911,903口
1口当たり純資産額（ / ）	4.4470円
（1万口当たり純資産額）	（44,470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 3月31日現在)

資産総額	315,762,072,932円
負債総額	200,099,668円
純資産総額（ - ）	315,561,973,264円
発行済口数	101,504,758,325口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1088円
（1万口当たり純資産額）	（31,088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 3月31日現在)

資産総額	109,079,734,690円
負債総額	433,397,055円
純資産総額（ - ）	108,646,337,635円
発行済口数	29,668,628,062口
1口当たり純資産額（ / ）	3.6620円
（1万口当たり純資産額）	（36,620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 3月31日現在)

資産総額	82,082,529,768円
負債総額	2,023,686円
純資産総額（ - ）	82,080,506,082円
発行済口数	46,787,209,218口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7543円
（1万口当たり純資産額）	（17,543円）

J - R E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 3月31日現在)

資産総額	116,810,554,073円
負債総額	608,284,955円
純資産総額（ - ）	116,202,269,118円
発行済口数	53,649,850,113口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1659円
（1万口当たり純資産額）	（21,659円）

グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2022年 3月31日現在)

資産総額	110,805,805,894円
負債総額	697,762,752円
純資産総額（ - ）	110,108,043,142円
発行済口数	40,091,542,112口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7464円
（1万口当たり純資産額）	（27,464円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

(2022年 3月31日現在)

資産総額	36,636,197,287円
負債総額	4,138,790,391円
純資産総額（ - ）	32,497,406,896円

発行済口数	24,195,657,263口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3431円
（1万口当たり純資産額）	（13,431円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2022年 3月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2022年 5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3月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	543	15,476,512
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	72	244,647
単位型公社債投資信託	51	245,101
合計	666	15,966,260

3【委託会社等の経理状況】

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

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

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。

(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		
金		
その他有価証券評価差額	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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		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・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの

軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針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。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それら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。

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	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		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	投資有価証券 子会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

(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いません。

[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(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,252	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

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(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

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				
	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5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。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円(2021年3月末日現在)

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

(2)販売会社

名称	資本金の額(百万円) (2021年3月末日現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

独立監査人の監査報告書

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 公認会計士 藤 澤 孝 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印
業務執行社員

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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年10月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 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」に掲げられているグローバル経済コアの2020年8月21日から2021年8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、グローバル経済コアの2021年8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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年4月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル経済コアの2021年8月21日から2022年2月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル経済コアの2022年2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中間計算期間（2021年8月21日から2022年2月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。