【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年10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】	上坪　直樹
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

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

（5）【申込手数料】

ありません。

（6）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（7）【申込期間】

2023年10月21日から2024年 4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＞
当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。
＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞
収益分配金の再投資の場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所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。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

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

DR(預託証券)とは

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

＜信託金限度額＞

上限　5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。
なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でもご覧いただけます。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

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

［投資対象地域による区分］

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

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

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

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

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

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

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

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

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

［独立した区分］

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

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

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

［補足分類］

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

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券
①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。
(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。
(5)資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。
①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］
(1)年1回…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
(2)年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
(3)年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
(4)年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
(5)年12回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
(6)日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］
(1)グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
(2)日本…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(3)北米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
(4)欧州…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とす

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

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

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

［インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分］
(1)日経225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

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

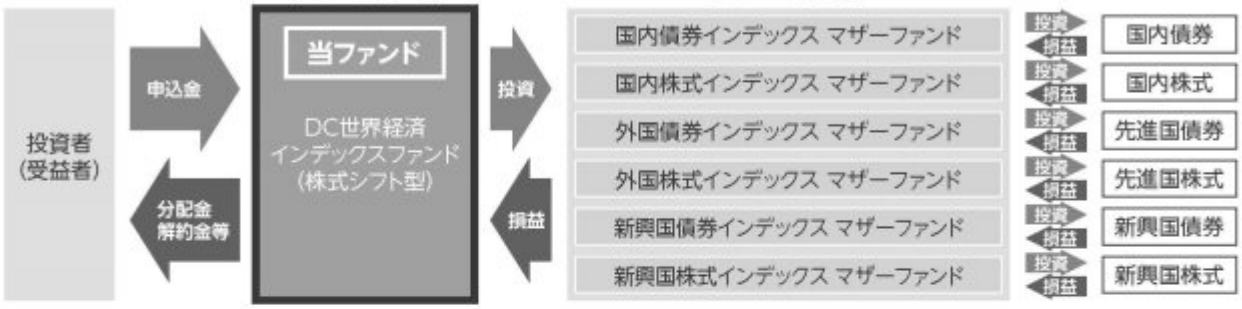
◆ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

＜ファンドの特色＞

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

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

ファンドのしくみ

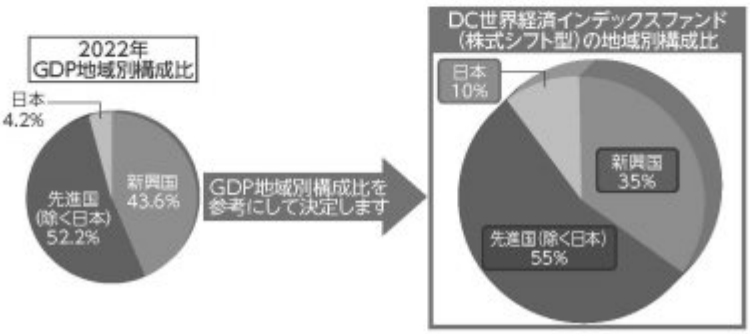


? ファミリーファンド方式とは

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

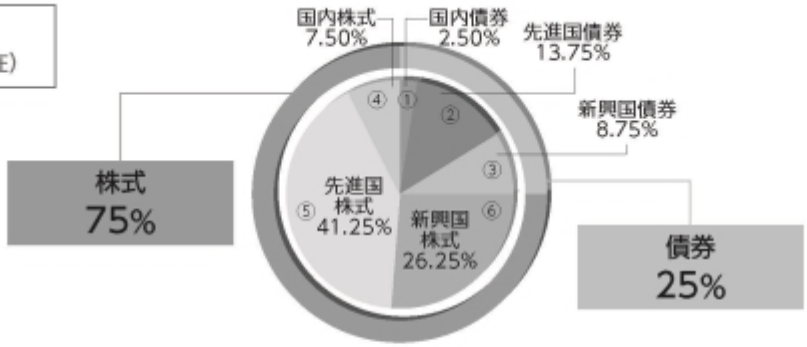
2. 世界経済全体の発展を享受します。

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



(出所)IMF「世界経済見通し2022年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。
※上記のファンドの地域別構成比は、2023年8月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

基本組入比率
(2023年8月末現在)



●基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

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

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

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

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

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

※2「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

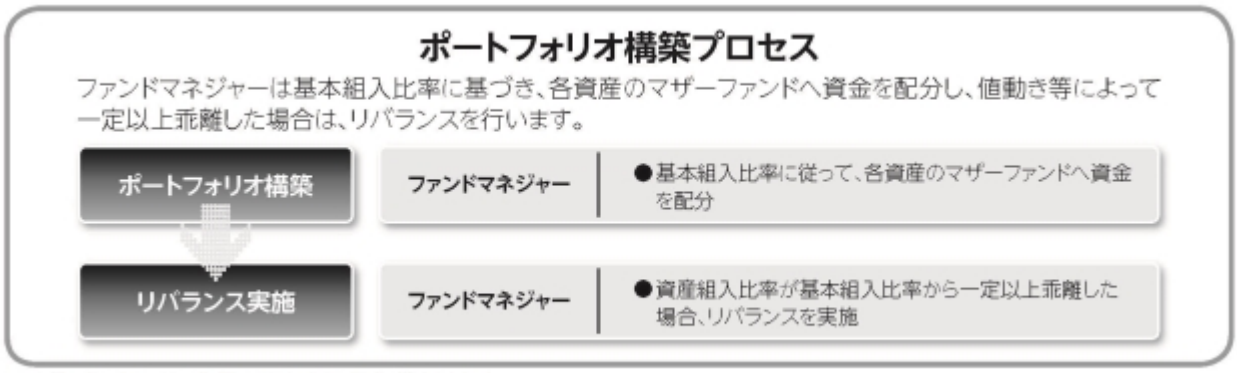
※3「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

※4「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みＴＯＰＩＸ」という。）の指数値及び配当込みＴＯＰＩＸ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、利用など配当込みＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みＴＯＰＩＸ

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、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。

※5「MSCIコクサイ・インデックス」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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「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指数です。MSCIコクサイ・インデックス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MSCIコクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※6「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「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指数です。MSCIエマージング・マーケット・インデックス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MSCIエマージング・マーケット・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

●原則として、毎年1月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
●分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%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。

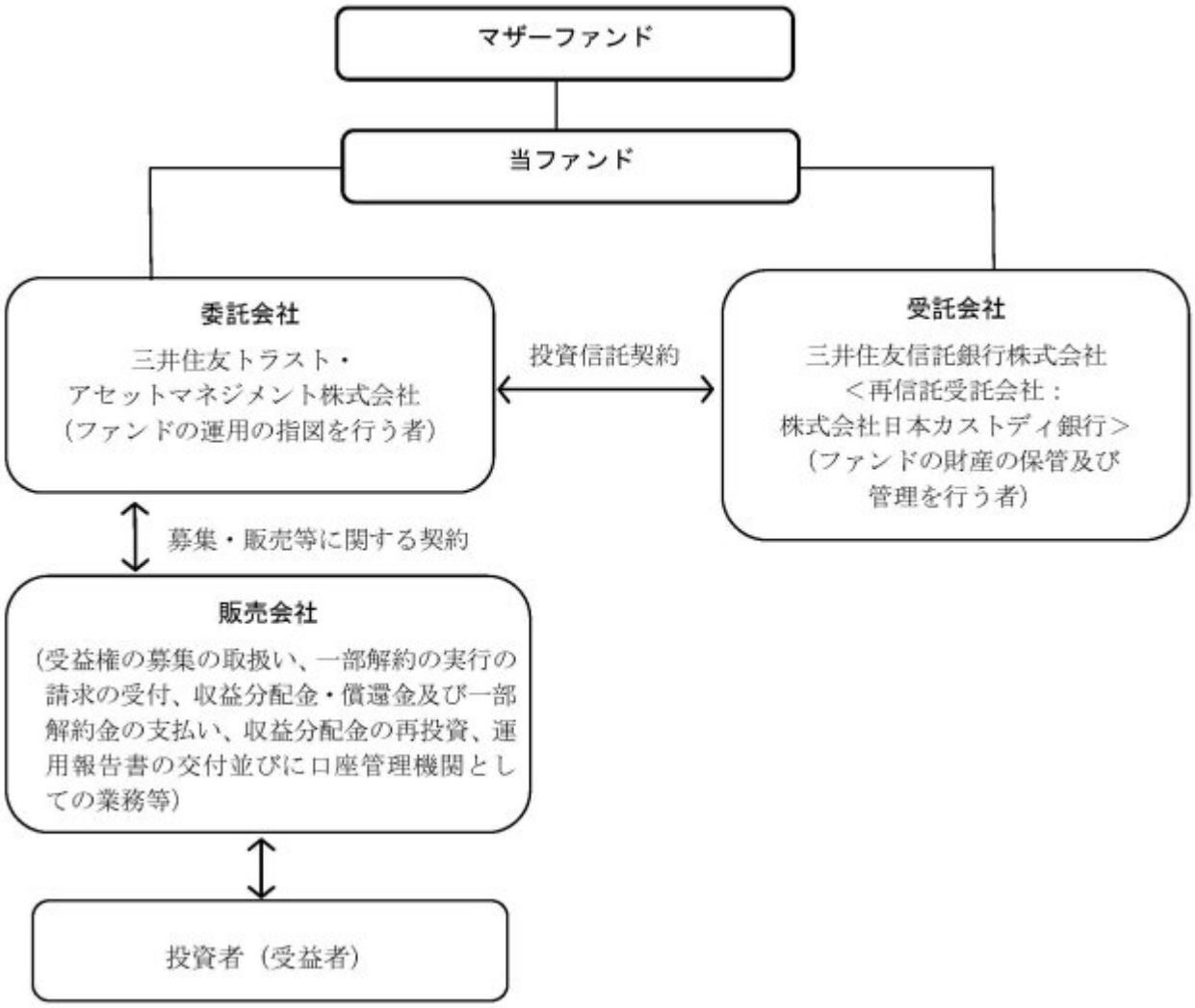
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（2）【ファンドの沿革】

2013年7月12日　当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2023年 8月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株　主　名	住　　所	持株数	持株比率

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

②投資対象

「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下総称して、又はそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下総称して、又はそれぞれを「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

③投資態度

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

ロ．株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式75%、債券25%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合もあります。

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

ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行います。

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

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

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1.有価証券

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

3.金銭債権

4.約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1.為替手形

②有価証券の指図範囲

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

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

28.外国の者に対する権利で第27号の有価証券の性質を有するもの

なお、第7号の証券又は証書、第18号ならびに第23号の証券又は証書のうち第7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8号から第12号までの証券及び第18号ならびに第23号の証券又は証書のうち第8号から第12号までの証券の性質を有するもの、及び第20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19号及び第20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。

③金融商品の指図範囲

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

1.預金

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

3.コール・ローン

4.手形割引市場において売買される手形

5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6.外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

(参考)マザーファンドの概要

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

３．運用制限

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

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

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

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総

額の10%以下とします。

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

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

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

④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

３．運用制限

①同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

①原則としてＭＳＣＩコクサイ・インデックス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(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。
⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

３．運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。
②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

②組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

３．運用制限

①株式への投資は行いません。

②同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

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

２．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

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

③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

３．運用制限

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

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

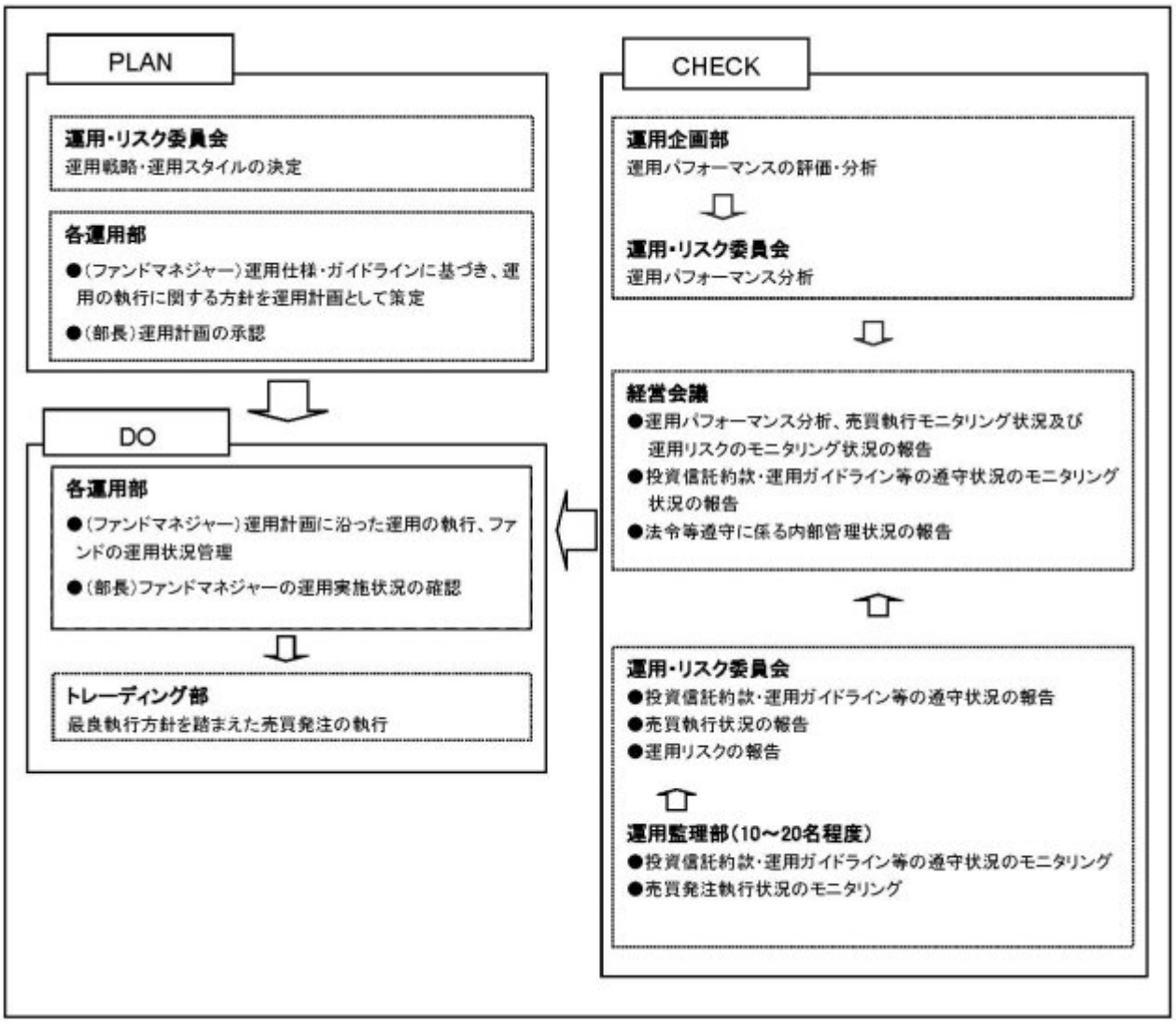
④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなっ

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年1月20日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

・分配対象額は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

・分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断にもとづき、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（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%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

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

1.投資信託財産に属する株券及び新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

5.投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行

使により取得可能な株券

6.投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、なら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（第5号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

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、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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、なら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。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、原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

チ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

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

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ヲ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、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。この指図は、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属す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。

ワ．資金の借入れ

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

うこととします。

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

＜関連法令に基づく投資制限＞

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク

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

②為替変動リスク

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

③金利変動リスク

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

④信用リスク

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

⑤カントリーリスク

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

⑥流動性リスク

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

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

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

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

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

⑤確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

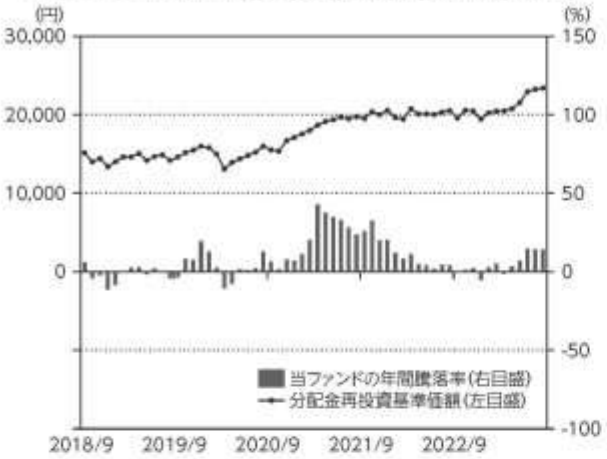
(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

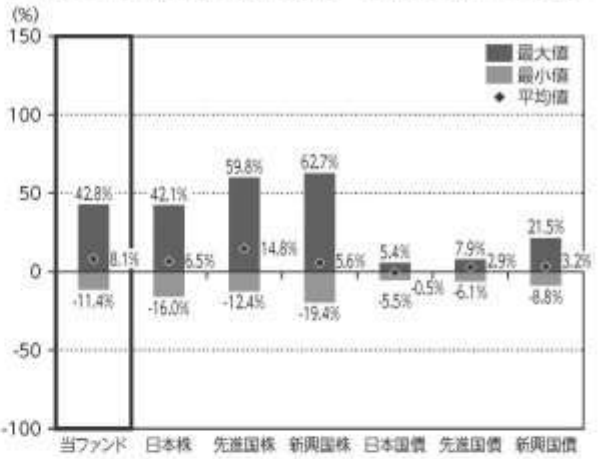
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



＊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



＊2018年9月～2023年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

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

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（※）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する新興国債券インデックス マザーファンド及び新興国株式インデックス マザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.605%（税抜　0.55%）（※）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　0.2805%　（税抜　0.255%）**	**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　0.2805%　（税抜　0.255%）**	**運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価**
受託会社	**年率　0.044%　（税抜　0.04%）**	**運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価**

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

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。
組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。
受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。
※上記は、2023年 8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。

(参考情報)ファンドの総経費率
直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.67%	0.60%	0.07%

※対象期間は2022年1月21日～2023年1月20日です。
※対象期間中の運用･管理にかかった費用の総額(原則として､購入時手数料､売買委託手数料及び有価証券取引税を除く｡)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。
※これらの値はあくまでも参考であり､実際に発生した費用の比率とは異なります。
※詳細につきましては､対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

５【運用状況】

以下は、2023年8月31日現在の状況について記載してあります。

【ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	17,537,839,780	99.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	155,122,355	0.88
合計(純資産総額)		17,692,962,135	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス　マザーファンド	1,453,008,245	4.1920	6,091,019,385	5.2777	7,668,541,614	43.34
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	1,120,175,320	3.5536	3,980,754,723	3.9172	4,387,950,763	24.80
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	675,255,090	3.0175	2,037,627,719	3.3251	2,245,290,699	12.69
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	698,058,121	1.8371	1,282,455,872	2.1424	1,495,519,718	8.45
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	577,382,172	1.9622	1,132,974,258	2.3701	1,368,453,485	7.73
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	277,736,435	1.3402	372,247,659	1.3397	372,083,501	2.10

(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	99.12
合計	99.12

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末　(2014年 1月20日)	1,113,212	1,113,212	11,132	11,132

第2期計算期間末	(2015年 1月20日)	260,663,230	260,663,230	12,709	12,709
第3期計算期間末	(2016年 1月20日)	786,476,196	786,476,196	11,144	11,144
第4期計算期間末	(2017年 1月20日)	1,527,874,637	1,527,874,637	12,805	12,805
第5期計算期間末	(2018年 1月22日)	2,862,203,968	2,862,203,968	15,465	15,465
第6期計算期間末	(2019年 1月21日)	4,026,889,787	4,026,889,787	13,941	13,941
第7期計算期間末	(2020年 1月20日)	6,365,443,282	6,365,443,282	16,326	16,326
第8期計算期間末	(2021年 1月20日)	8,447,670,638	8,447,670,638	17,659	17,659
第9期計算期間末	(2022年 1月20日)	11,105,383,016	11,105,383,016	19,989	19,989
第10期計算期間末	(2023年 1月20日)	13,034,913,362	13,034,913,362	19,671	19,671
	2022年 8月末日	12,644,362,558	—	20,502	—
	9月末日	12,411,412,622	—	19,549	—
	10月末日	13,146,538,596	—	20,553	—
	11月末日	13,309,122,144	—	20,458	—
	12月末日	12,863,823,151	—	19,442	—
	2023年 1月末日	13,523,674,839	—	20,219	—
	2月末日	13,663,615,498	—	20,422	—
	3月末日	14,039,071,717	—	20,473	—
	4月末日	14,358,884,665	—	20,735	—
	5月末日	15,526,067,070	—	21,535	—
	6月末日	16,929,214,618	—	22,930	—
	7月末日	17,280,406,316	—	23,207	—
	8月末日	17,692,962,135	—	23,397	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2013年 7月12日～2014年 1月20日	0
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	0
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	0
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	0
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	0
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	0
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	0
第8期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	0
第9期計算期間	2021年 1月21日～2022年 1月20日	0
第10期計算期間	2022年 1月21日～2023年 1月20日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2013年 7月12日～2014年 1月20日	11.3

第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	14.2
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	△12.3
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	14.9
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	20.8
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	△9.9
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	17.1
第8期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	8.2
第9期計算期間	2021年 1月21日～2022年 1月20日	13.2
第10期計算期間	2022年 1月21日～2023年 1月20日	△1.6
第11期中間計算期間	2023年 1月21日～2023年 7月20日	16.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2013年 7月12日～2014年 1月20日	1,000,000	―	1,000,000
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	207,048,609	2,939,471	205,109,138
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	540,137,206	39,487,441	705,758,903
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	549,806,259	62,412,277	1,193,152,885
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	815,901,772	158,315,097	1,850,739,560
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	1,221,325,867	183,620,278	2,888,445,149
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	1,325,160,900	314,562,483	3,899,043,566
第8期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	1,417,302,063	532,508,199	4,783,837,430
第9期計算期間	2021年 1月21日～2022年 1月20日	1,489,212,801	717,429,916	5,555,620,315
第10期計算期間	2022年 1月21日～2023年 1月20日	1,616,941,215	545,958,512	6,626,603,018
第11期中間計算期間	2023年 1月21日～2023年 7月20日	1,093,915,102	333,857,586	7,386,660,534

(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	544,546,881,890	84.35
地方債証券	日本	32,950,781,350	5.10
特殊債券	日本	36,503,207,087	5.65
社債券	日本	27,533,630,000	4.26

	フランス	1,694,196,000	0.26
	スペイン	398,544,000	0.06
	韓国	99,587,000	0.02
	小計	29,725,957,000	4.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,881,281,179	0.29
合計(純資産総額)		645,608,108,506	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３５０回利付国債（１０年）	6,670,000,000	100.04	6,673,134,900	99.61	6,644,387,200	0.100	2028/3/20	1.03
日本	国債証券	第１５０回利付国債（５年）	6,410,000,000	100.08	6,415,128,000	99.73	6,393,077,600	0.005	2026/12/20	0.99
日本	国債証券	第１４８回利付国債（５年）	6,210,000,000	100.15	6,219,794,300	99.84	6,200,436,600	0.005	2026/6/20	0.96
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	6,367,000,000	97.88	6,232,019,600	96.65	6,154,151,190	0.100	2031/12/20	0.95
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	5,900,000,000	100.44	5,926,373,000	100.09	5,905,369,000	0.100	2026/9/20	0.91
日本	国債証券	第１５３回利付国債（５年）	5,810,000,000	99.98	5,809,007,400	99.54	5,783,622,600	0.005	2027/6/20	0.90
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	5,750,000,000	100.39	5,772,942,500	99.98	5,748,965,000	0.100	2027/3/20	0.89
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	5,430,000,000	98.19	5,331,733,000	97.14	5,274,810,600	0.100	2031/6/20	0.82
日本	国債証券	第１５４回利付国債（５年）	5,180,000,000	100.30	5,195,603,800	99.83	5,171,608,400	0.100	2027/9/20	0.80
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	5,120,000,000	100.37	5,138,944,000	100.17	5,128,908,800	0.100	2025/9/20	0.79
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	5,120,000,000	100.18	5,129,267,200	99.74	5,106,841,600	0.100	2027/12/20	0.79
日本	国債証券	第３６８回利付国債（１０年）	5,230,000,000	98.21	5,136,876,900	96.77	5,061,227,900	0.200	2032/9/20	0.78
日本	国債証券	第１４９回利付国債（５年）	5,070,000,000	100.13	5,076,741,500	99.80	5,059,961,400	0.005	2026/9/20	0.78
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	5,050,000,000	100.33	5,066,665,000	100.18	5,059,090,000	0.100	2025/6/20	0.78
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	5,020,000,000	100.90	5,065,631,800	100.62	5,051,124,000	0.300	2025/12/20	0.78
日本	国債証券	第３６６回利付国債（１０年）	5,160,000,000	98.53	5,084,268,600	97.26	5,018,667,600	0.200	2032/3/20	0.78
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	5,070,000,000	98.82	5,010,412,800	97.94	4,965,659,400	0.100	2030/9/20	0.77
日本	国債証券	第３６４回利付国債（１０年）	5,050,000,000	98.02	4,950,010,000	96.90	4,893,601,500	0.100	2031/9/20	0.76
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	4,835,000,000	99.94	4,832,534,150	99.47	4,809,712,950	0.100	2028/6/20	0.74

日本	国債証券	第３７０回利付国債（１０年）	4,860,000,000	100.83	4,900,471,300	98.96	4,809,553,200	0.500	2033/3/20	0.74
日本	国債証券	第１４６回利付国債（５年）	4,800,000,000	100.39	4,818,720,000	100.16	4,807,680,000	0.100	2025/12/20	0.74
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	4,760,000,000	100.42	4,780,039,600	100.13	4,766,616,400	0.100	2026/3/20	0.74
日本	国債証券	第３６７回利付国債（１０年）	4,900,000,000	98.42	4,822,727,000	97.02	4,754,029,000	0.200	2032/6/20	0.74
日本	国債証券	第３６９回利付国債（１０年）	4,740,000,000	100.79	4,777,800,400	99.20	4,702,364,400	0.500	2032/12/20	0.73
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	4,720,000,000	99.71	4,706,406,400	99.07	4,676,104,000	0.100	2029/3/20	0.72
日本	国債証券	第３６２回利付国債（１０年）	4,760,000,000	98.46	4,686,863,400	97.40	4,636,668,400	0.100	2031/3/20	0.72
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	4,660,000,000	99.64	4,643,224,000	98.91	4,609,485,600	0.100	2029/6/20	0.71
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	4,560,000,000	100.85	4,599,124,800	100.65	4,590,004,800	0.400	2025/3/20	0.71
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	4,690,000,000	98.58	4,623,759,600	97.66	4,580,394,700	0.100	2030/12/20	0.71
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	4,630,000,000	99.53	4,608,540,800	98.75	4,572,217,600	0.100	2029/9/20	0.71

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.35
地方債証券	5.10
特殊債券	5.65
社債券	4.60
合計	99.71

(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の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

国内株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	572,309,482,080	99.46

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,080,850,851	0.54
合計(純資産総額)		575,390,332,931	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	2,889,820,000	0.50

(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	9,474,700	1,933.20	18,316,568,285	2,515.00	23,828,870,500	4.14
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,220,600	13,273.18	16,201,249,583	12,145.00	14,824,187,000	2.58
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	10,643,000	929.89	9,896,838,868	1,163.50	12,383,130,500	2.15
日本	株式	キーエンス	電気機器	172,600	68,599.15	11,840,213,795	60,520.00	10,445,752,000	1.82
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	55,437,200	162.74	9,022,344,400	168.30	9,330,080,760	1.62
日本	株式	日立製作所	電気機器	847,500	8,140.92	6,899,432,191	9,694.00	8,215,665,000	1.43
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,207,800	5,657.14	6,832,697,785	6,681.00	8,069,311,800	1.40
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,113,100	5,920.19	6,589,768,511	7,196.00	8,009,867,600	1.39
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	365,200	19,731.43	7,205,918,772	21,575.00	7,879,190,000	1.37
日本	株式	三井物産	卸売業	1,295,700	4,643.81	6,016,992,509	5,432.00	7,038,242,400	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,531,500	4,537.53	6,949,232,317	4,508.00	6,904,002,000	1.20
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,313,300	4,444.89	5,837,480,468	5,220.00	6,855,426,000	1.19
日本	株式	任天堂	その他製品	1,089,400	5,913.83	6,442,534,791	6,267.00	6,827,269,800	1.19
日本	株式	信越化学工業	化学	1,436,700	4,405.13	6,328,859,104	4,659.00	6,693,585,300	1.16
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,402,600	4,030.30	5,652,899,504	4,703.00	6,596,427,800	1.15
日本	株式	第一三共	医薬品	1,507,600	4,542.39	6,848,110,847	4,299.00	6,481,172,400	1.13
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,124,900	4,952.08	5,570,598,905	5,472.00	6,155,452,800	1.07
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,457,700	2,077.66	5,106,286,091	2,410.00	5,923,057,000	1.03
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	365,600	17,157.02	6,272,608,313	16,155.00	5,906,268,000	1.03

日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,337,300	4,356.19	5,825,543,454	4,325.00	5,783,822,500	1.01
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	853,700	5,557.36	4,744,319,815	6,545.00	5,587,466,500	0.97
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,679,800	3,112.44	5,228,279,266	3,227.00	5,420,714,600	0.94
日本	株式	ダイキン工業	機械	208,100	26,765.02	5,569,801,008	25,225.00	5,249,322,500	0.91
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	938,800	5,374.73	5,045,800,593	5,249.00	4,927,761,200	0.86
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,781,400	1,511.19	4,203,240,848	1,670.00	4,644,938,000	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	523,300	8,258.05	4,321,442,503	8,185.00	4,283,210,500	0.74
日本	株式	ＳＭＣ	機械	56,500	74,555.98	4,212,413,139	70,600.00	3,988,900,000	0.69
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	629,200	6,147.32	3,867,899,404	5,981.00	3,763,245,200	0.65
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,634,800	2,294.22	3,750,593,009	2,214.50	3,620,264,600	0.63
日本	株式	デンソー	輸送用機器	355,900	8,788.32	3,127,764,669	9,959.00	3,544,408,100	0.62

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.36
		建設業	2.10
		食料品	3.37
		繊維製品	0.41
		パルプ・紙	0.17
		化学	5.94
		医薬品	5.11
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.68
		鉄鋼	0.98
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.51
		機械	5.48
		電気機器	17.22
		輸送用機器	8.31
		精密機器	2.38
		その他製品	2.27
		電気・ガス業	1.37
		陸運業	2.95
		海運業	0.66
		空運業	0.49

		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	8.06
		卸売業	6.80
		小売業	4.36
		銀行業	6.54
		証券、商品先物取引業	0.73
		保険業	2.24
		その他金融業	1.16
		不動産業	1.88
		サービス業	4.89
		小計	99.46
合計			99.46

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	124	円	2,828,834,150	2,889,820,000	0.50

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

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

外国債券インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	138,132,338,685	47.67
	フランス	23,757,955,024	8.20
	イタリア	21,815,912,993	7.53
	ドイツ	18,735,722,743	6.47
	中国	17,403,324,988	6.01
	スペイン	14,156,305,805	4.89
	イギリス	14,113,967,022	4.87
	カナダ	5,719,273,086	1.97
	ベルギー	5,237,404,044	1.81

	オランダ	4,260,493,331	1.47
	オーストラリア	4,206,738,164	1.45
	オーストリア	3,466,486,807	1.20
	メキシコ	2,890,041,510	1.00
	アイルランド	1,691,697,359	0.58
	フィンランド	1,500,988,793	0.52
	マレーシア	1,500,271,597	0.52
	ポーランド	1,438,349,470	0.50
	シンガポール	1,264,722,223	0.44
	デンマーク	926,320,520	0.32
	イスラエル	854,697,308	0.29
	ニュージーランド	625,411,811	0.22
	スウェーデン	559,463,659	0.19
	ノルウェー	461,801,500	0.16
	小計	284,719,688,442	98.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,027,857,560	1.74
合計(純資産総額)		289,747,546,002	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	884,328,400	0.31
	買建	ドイツ	852,305,241	0.29

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	1,991,737,271	0.69

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	13,800,000	13,425.84	1,852,766,324	13,104.88	1,808,474,588	2.750	2032/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,719.67	1,603,829,506	13,588.60	1,588,507,879	2.375	2027/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	10,860,000	13,765.35	1,494,917,902	13,854.16	1,504,562,136	0.750	2024/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,084.19	1,520,191,795	11,834.20	1,488,742,939	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	14,128.90	1,441,148,549	14,136.28	1,441,900,923	3.125	2025/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,550.07	1,470,868,287	12,271.66	1,438,238,845	1.875	2032/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	14,070.03	1,428,108,723	14,105.44	1,431,702,623	2.250	2024/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	13,907.02	1,399,046,913	13,722.24	1,380,457,406	2.875	2028/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,698.56	1,397,979,104	11,499.82	1,374,229,598	0.625	2030/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,587.46	1,372,333,713	13,268.22	1,340,090,326	2.875	2032/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,884.17	1,325,085,549	11,686.00	1,302,989,659	0.875	2030/11/15	0.45
中国	国債証券	CGB 2.69% 08/12/26	63,900,000	2,021.26	1,291,590,178	2,027.94	1,295,857,911	2.690	2026/8/12	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	13,228.24	1,256,683,233	13,212.82	1,255,218,375	0.750	2026/4/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/30/27	9,880,000	12,509.23	1,235,912,665	12,446.98	1,229,762,445	0.375	2027/9/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	13,908.98	1,223,990,972	13,960.38	1,228,514,027	1.500	2024/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	12,563.20	1,206,067,767	12,481.25	1,198,200,378	0.625	2027/12/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	12,728.82	1,209,238,187	12,598.32	1,196,841,171	1.250	2028/9/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/30/24	8,500,000	13,965.24	1,187,045,482	14,034.62	1,192,943,460	1.500	2024/9/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	13,965.52	1,181,483,553	13,980.37	1,182,739,725	2.000	2025/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/28/25	8,500,000	13,743.08	1,168,162,269	13,783.91	1,171,633,094	1.125	2025/2/28	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.875% 11/30/29	8,130,000	14,493.36	1,178,310,829	14,305.04	1,162,999,895	3.875	2029/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	14,026.91	1,178,261,202	13,825.60	1,161,351,118	3.125	2028/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	12,761.32	1,148,518,902	12,682.85	1,141,456,500	1.250	2028/6/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 1% 12/15/24	8,000,000	13,783.91	1,102,713,500	13,854.16	1,108,333,065	1.000	2024/12/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	7,550,000	14,980.93	1,131,060,309	14,593.15	1,101,783,471	4.125	2032/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 4% 11/15/52	7,800,000	14,752.49	1,150,694,512	14,058.04	1,096,527,412	4.000	2052/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/53	8,350,000	13,963.19	1,165,926,950	13,123.73	1,095,831,819	3.625	2053/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	9,230,000	12,021.80	1,109,612,973	11,792.51	1,088,449,115	1.250	2031/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	13,490.66	1,079,252,974	13,540.06	1,083,204,935	0.375	2025/4/30	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/28	8,480,000	12,869.59	1,091,341,882	12,758.23	1,081,898,273	1.250	2028/3/31	0.37

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.26
合計	98.26

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	23	アメリカドル	2,455,908.19	359,053,777	2,456,507.87	359,141,450	0.12
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	16	アメリカドル	1,773,294.88	259,255,712	1,773,500	259,285,700	0.09
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	15	アメリカドル	1,818,792	265,907,390	1,818,750	265,901,250	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	10	ユーロ	1,049,871	167,811,381	1,049,600	167,768,064	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	13	ユーロ	1,502,957.3	240,232,694	1,503,710	240,353,006	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	21	ユーロ	2,776,324.1	443,767,644	2,778,930	444,184,171	0.15

(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	6,980,000.00	1,009,734,253	1,017,984,838	0.35
	カナダドル	買建	720,000.00	77,121,520	77,588,712	0.03
	ユーロ	買建	4,150,000.00	655,425,126	662,176,905	0.23
	イギリスポンド	買建	560,000.00	102,713,327	103,885,768	0.04
	オフショア人民元	買建	6,510,000.00	129,856,408	130,101,048	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	410,763,890,131	68.45
	イギリス	23,903,792,974	3.98
	カナダ	19,975,930,424	3.33
	フランス	19,010,551,334	3.17

	スイス	18,715,940,846	3.12
	ドイツ	14,228,503,990	2.37
	オーストラリア	11,190,502,349	1.86
	オランダ	11,110,085,107	1.85
	アイルランド	10,951,759,132	1.82
	デンマーク	5,562,706,419	0.93
	スウェーデン	4,832,001,747	0.81
	スペイン	4,317,215,226	0.72
	イタリア	3,214,159,469	0.54
	香港	3,019,438,592	0.50
	フィンランド	1,868,208,784	0.31
	シンガポール	1,846,211,992	0.31
	ジャージー	1,667,341,999	0.28
	ベルギー	1,271,592,216	0.21
	イスラエル	1,175,350,477	0.20
	ノルウェー	1,135,403,917	0.19
	キュラソー	910,573,951	0.15
	バミューダ	894,930,680	0.15
	ケイマン	850,688,149	0.14
	ニュージーランド	442,851,482	0.07
	ルクセンブルク	358,834,170	0.06
	ポルトガル	335,591,110	0.06
	オーストリア	331,542,270	0.06
	リベリア	247,583,419	0.04
	パナマ	166,613,131	0.03
	マン島	107,422,051	0.02
	小計	574,407,217,538	95.72
投資信託受益証券	オーストラリア	117,785,441	0.02
	香港	49,940,509	0.01
	小計	167,725,950	0.03
投資証券	アメリカ	10,034,038,043	1.67
	オーストラリア	731,082,483	0.12
	シンガポール	243,800,043	0.04
	フランス	231,389,059	0.04
	イギリス	217,860,148	0.04
	香港	122,974,673	0.02
	カナダ	58,725,127	0.01
	ベルギー	54,494,187	0.01
	小計	11,694,363,763	1.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	13,834,620,058	2.31
合計(純資産総額)		600,103,927,309	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	10,020,897,052	1.67
	買建	カナダ	473,830,560	0.08
	買建	ドイツ	2,058,219,679	0.34
	買建	イギリス	640,158,908	0.11
	買建	オーストラリア	481,605,614	0.08

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	944,050,498	0.16

(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	1,176,051	25,647.86	30,163,198,457	27,434.43	32,264,288,836	5.38
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	525,636	48,665.59	25,580,388,167	48,069.09	25,266,848,396	4.21
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	686,233	17,560.08	12,050,307,752	19,747.23	13,551,203,630	2.26
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	184,802	57,028.85	10,539,045,621	72,023.96	13,310,173,334	2.22
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	442,712	18,217.98	8,065,319,247	19,865.65	8,794,764,299	1.47
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	213,419	28,401.37	6,061,393,096	37,558.78	8,015,757,269	1.34

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	399,244	18,337.86	7,321,282,973	20,019.16	7,992,531,910	1.33
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	165,576	38,338.01	6,347,855,475	43,143.61	7,143,548,025	1.19
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	97,275	46,919.21	4,564,066,635	52,786.97	5,134,852,701	0.86
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	69,912	70,410.30	4,922,525,377	71,861.68	5,023,994,192	0.84
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	301,729	15,346.61	4,630,518,495	16,210.65	4,891,225,024	0.82
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,535	62,405.09	3,777,692,140	80,116.13	4,849,830,414	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	217,897	20,019.16	4,362,116,214	21,660.99	4,719,865,174	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	120,784	32,890.61	3,972,659,922	35,998.82	4,348,082,200	0.72
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	179,427	22,565.96	4,048,944,299	23,937.32	4,295,002,592	0.72
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	30,991	118,821.12	3,682,385,516	130,451.33	4,042,817,354	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	177,374	21,271.88	3,773,080,148	22,520.64	3,994,577,418	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	63,267	54,732.89	3,462,786,004	60,513.64	3,828,516,588	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	75,273	42,811.74	3,222,568,557	48,338.10	3,638,554,253	0.61
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	199,766	18,649.08	3,725,454,033	17,700.15	3,535,888,884	0.59
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	123,050	24,401.52	3,002,607,036	27,627.60	3,399,576,180	0.57
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	135,745	22,539.40	3,059,611,365	23,418.31	3,178,919,305	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	191,177	16,235.34	3,103,824,992	16,112.70	3,080,378,030	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	29,993	109,007.68	3,269,467,442	97,614.28	2,927,745,340	0.49
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	133,056	20,134.09	2,678,961,485	21,684.38	2,885,237,397	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	34,096	60,730.01	2,070,650,694	79,731.63	2,718,529,725	0.45
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	102,377	26,836.47	2,747,437,494	26,473.89	2,710,318,051	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	305,497	8,810.01	2,691,432,236	8,840.71	2,700,811,605	0.45
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	20,525	134,825.04	2,767,283,946	128,511.36	2,637,695,664	0.44
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	32,965	74,161.41	2,444,730,947	79,278.41	2,613,412,852	0.44

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	5.00
		素材	3.95
		資本財	6.57
		商業・専門サービス	1.52
		運輸	1.79
		自動車・自動車部品	2.15
		耐久消費財・アパレル	1.60
		消費者サービス	2.06
		メディア・娯楽	5.93
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.39
		生活必需品流通・小売り	1.68
		食品・飲料・タバコ	3.81
		家庭用品・パーソナル用品	1.72
		ヘルスケア機器・サービス	4.35
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.41
		銀行	5.13
		金融サービス	6.43
		保険	2.96
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.04
		ソフトウェア・サービス	9.21
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.76
		電気通信サービス	1.11
		公益事業	2.69
		半導体・半導体製造装置	6.11
		不動産管理・開発	0.33
		小計	95.72
投資信託受益証券	—	—	0.03
投資証券	—	—	1.95
合計			97.69

(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	303	アメリカドル	67,885,896.15	9,924,918,017	68,542,387.5	10,020,897,052	1.67
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	18	カナダドル	4,342,313	468,969,804	4,387,320	473,830,560	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	35	スイスフラン	3,870,915	644,429,929	3,888,150	647,299,212	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	204	ユーロ	8,744,892.8	1,397,783,665	8,827,080	1,410,920,467	0.24
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	28	オーストラリアドル	5,000,096	473,909,099	5,081,300	481,605,614	0.08
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	46	イギリスポンド	3,408,197.5	633,754,325	3,442,640	640,158,908	0.11

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	5,270,000.00	769,472,700	770,348,574	0.13
	ユーロ	買建	410,000.00	65,488,480	65,496,229	0.01
	スイスフラン	買建	650,000.00	108,020,250	108,205,695	0.02

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

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

新興国債券インデックス　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	中国	11,600,224,494	9.93
	インドネシア	11,508,370,682	9.85
	ブラジル	11,493,552,340	9.84
	マレーシア	11,467,593,470	9.82
	メキシコ	11,456,198,219	9.81
	タイ	11,196,024,063	9.58
	南アフリカ	9,355,423,938	8.01
	ポーランド	8,625,626,872	7.38

	チェコ	7,030,936,507	6.02
	コロンビア	5,005,973,682	4.29
	ルーマニア	4,265,405,687	3.65
	ハンガリー	3,456,618,917	2.96
	ペルー	2,768,801,124	2.37
	チリ	2,338,416,573	2.00
	ウルグアイ	256,412,460	0.22
	ドミニカ共和国	210,115,321	0.18
	フィリピン	74,787,439	0.06
	小計	112,110,481,788	95.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,706,129,122	4.03
合計(純資産総額)		116,816,610,910	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	65,300,000,000	3.04	1,986,796,361	3.50	2,289,268,594	9.850	2027/6/28	1.96
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	2,077.80	1,589,517,055	2,384.74	1,824,330,925	0.000	2026/1/1	1.56
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,241.76	1,748,577,560	2,272.27	1,772,374,657	0.000	2026/7/1	1.52
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	55,300,000	2,890.79	1,598,609,054	2,963.11	1,638,603,763	10.000	2025/1/1	1.40
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	198,400,000	825.82	1,638,445,530	818.11	1,623,144,178	10.500	2026/12/21	1.39
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	50,400,000	2,785.01	1,403,648,209	2,966.41	1,495,074,709	10.000	2027/1/1	1.28
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	49,700,000	2,790.07	1,386,666,534	2,911.29	1,446,913,372	10.000	2029/1/1	1.24
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000	783.14	1,379,123,653	798.02	1,405,324,400	7.750	2031/5/29	1.20
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	775.53	1,359,518,336	791.70	1,387,865,587	5.750	2026/3/5	1.19
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	190,600,000	689.44	1,314,087,203	701.90	1,337,829,453	8.000	2030/1/31	1.15
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	45,100,000,000	2.35	1,061,400,406	2.79	1,261,110,957	7.250	2034/10/18	1.08
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	46,400,000	2,219.84	1,030,006,280	2,502.43	1,161,132,068	0.000	2025/7/1	0.99
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	811.42	1,127,883,207	815.20	1,133,137,441	7.500	2027/6/3	0.97
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000	666.94	1,103,789,718	664.39	1,099,576,538	8.250	2032/3/31	0.94
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	841.40	1,080,364,304	847.02	1,087,574,516	8.000	2024/9/5	0.93
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000	611.19	1,110,546,581	567.24	1,030,675,625	8.750	2048/2/28	0.88
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	37,250,000	2,489.70	927,415,013	2,738.78	1,020,198,642	0.000	2024/7/1	0.87
マレーシア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	34,300,000	2,767.44	949,232,574	2,897.56	993,863,546	2.632	2031/4/15	0.85

南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000	660.93	998,016,278	645.30	974,404,887	8.875	2035/2/28	0.83
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000	3,159.89	906,889,244	3,179.44	912,502,054	3.955	2025/9/15	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	105,600,000	835.77	882,580,393	841.28	888,394,851	8.500	2029/5/31	0.76
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	34,900,000,000	2.00	699,949,223	2.45	855,098,255	7.250	2050/10/26	0.73
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000	417.28	847,509,413	415.01	842,901,279	2.125	2026/12/17	0.72
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	109,000,000	759.71	828,090,099	766.20	835,164,390	5.500	2027/3/4	0.71
マレーシア	国債証券	MGS 3.757% 05/22/40	27,350,000	2,831.44	774,400,126	3,012.22	823,844,807	3.757	2040/5/22	0.71
タイ	国債証券	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000	445.45	801,810,108	451.84	813,320,775	3.775	2032/6/25	0.70
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000	2,648.33	691,215,241	3,100.60	809,259,180	2.750	2029/10/25	0.69
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000	780.68	767,417,058	810.57	796,791,504	8.500	2038/11/18	0.68
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000	3,201.97	738,055,154	3,449.21	795,044,513	3.250	2025/7/25	0.68
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	129,700,000	620.01	804,160,249	599.96	778,153,567	8.500	2037/1/31	0.67

(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	95.97
合計	95.97

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

新興国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	ケイマン	27,050,109,745	16.89
	インド	23,322,598,626	14.56
	台湾	22,794,651,273	14.23

	韓国	19,422,872,079	12.13
	中国	17,018,040,802	10.63
	ブラジル	7,978,681,363	4.98
	サウジアラビア	6,464,812,403	4.04
	南アフリカ	4,737,447,425	2.96
	メキシコ	4,020,147,696	2.51
	タイ	3,132,806,039	1.96
	インドネシア	3,065,647,592	1.91
	マレーシア	2,157,469,773	1.35
	アラブ首長国連邦	2,069,520,439	1.29
	香港	1,488,858,995	0.93
	カタール	1,456,529,995	0.91
	クウェート	1,224,904,979	0.76
	ポーランド	1,174,632,262	0.73
	トルコ	1,109,786,899	0.69
	フィリピン	934,104,855	0.58
	チリ	799,303,067	0.50
	ギリシャ	740,207,123	0.46
	アメリカ	709,711,762	0.44
	バミューダ	644,968,275	0.40
	ハンガリー	402,864,849	0.25
	チェコ	258,967,055	0.16
	ルクセンブルク	211,452,811	0.13
	コロンビア	144,748,861	0.09
	エジプト	71,450,718	0.04
	オランダ	26,228,656	0.02
	シンガポール	25,982,888	0.02
	ペルー	21,360,683	0.01
	ロシア	115	0.00
	キプロス	—	—
	英ヴァージン諸島	—	—
	小計	154,680,870,103	96.59
投資信託受益証券	ブラジル	355,233,604	0.22
	メキシコ	126,888,000	0.08
	小計	482,121,604	0.30
投資証券	メキシコ	87,334,076	0.05
	南アフリカ	45,240,747	0.03
	小計	132,574,823	0.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,843,165,986	3.02
合計(純資産総額)		160,138,732,516	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,904,004,144	3.06

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

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

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	—	654,995,910	0.41
	売建	—	6,202,266	△0.00

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	3,886,389	2,026.81	7,876,980,972	2,544.61	9,889,381,234	6.18
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,059,100	4,874.71	5,162,807,428	6,069.65	6,428,370,551	4.01
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	750,499	6,937.71	5,206,751,043	7,434.67	5,579,719,905	3.48
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2,603,988	1,377.57	3,587,198,318	1,683.22	4,383,085,983	2.74
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	481,342	4,144.46	1,994,905,192	4,304.57	2,071,972,258	1.29
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	806,150	2,613.26	2,106,684,633	2,500.14	2,015,492,698	1.26
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	812,223	1,611.54	1,308,934,697	1,705.95	1,385,613,451	0.87
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	532,498	2,639.84	1,405,713,267	2,554.38	1,360,207,034	0.85
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	461,405	2,696.20	1,244,042,716	2,810.53	1,296,793,056	0.81
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	15,201,620	85.04	1,292,835,965	78.05	1,186,633,897	0.74

ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	80,974	9,257.32	749,602,947	14,348.06	1,161,820,458	0.73
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	87,370	10,035.82	876,830,454	13,229.51	1,155,863,162	0.72
ブラジル	株式	VALE SA	素材	525,387	2,250.87	1,182,579,364	1,941.35	1,019,962,929	0.64
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	313,630	1,948.94	611,248,553	3,029.23	950,059,914	0.59
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	1,938,248	469.80	910,597,723	485.99	941,987,365	0.59
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	379,111	3,160.42	1,198,150,676	2,455.43	930,882,039	0.58
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,058,000	741.94	784,972,790	876.54	927,380,907	0.58
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	351,450	1,721.78	605,121,198	2,542.99	893,735,593	0.56
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	143,181	5,741.36	822,054,016	6,034.28	863,995,533	0.54
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	291,473	3,283.65	957,096,599	2,830.39	824,985,179	0.52
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	133,027	6,249.73	831,383,918	6,082.92	809,192,599	0.51
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	241,804	2,974.66	719,285,736	3,250.69	786,030,836	0.49
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	169,000	3,822.00	645,918,192	4,560.62	770,745,456	0.48
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	8,689,300	85.26	740,932,970	88.32	767,438,976	0.48
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	30,591	18,494.47	565,764,347	24,867.43	760,719,566	0.48
韓国	株式	POSCO HOLDINGS INC	素材	11,785	33,122.33	390,346,755	64,264.00	757,351,240	0.47
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	728,040	800.46	582,770,316	974.56	709,519,859	0.44
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	780,281	824.16	643,077,880	826.67	645,038,370	0.40
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	594,100	894.79	531,596,040	1,060.60	630,105,490	0.39
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	359,795	1,554.55	559,320,228	1,748.93	629,259,508	0.39

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	5.01
		素材	7.76
		資本財	4.54
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	2.04

		自動車・自動車部品	3.65
		耐久消費財・アパレル	1.29
		消費者サービス	2.78
		メディア・娯楽	6.73
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.69
		生活必需品流通・小売り	1.59
		食品・飲料・タバコ	3.59
		家庭用品・パーソナル用品	0.76
		ヘルスケア機器・サービス	1.02
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.66
		銀行	15.76
		金融サービス	2.43
		保険	2.68
		ソフトウェア・サービス	2.37
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.60
		電気通信サービス	2.67
		公益事業	2.43
		半導体・半導体製造装置	8.90
		不動産管理・開発	1.62
		小計	96.59
投資信託受益証券	—	—	0.30
投資証券	—	—	0.08
合計			96.98

(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	676	アメリカドル	33,979,399	4,967,788,134	33,543,120	4,904,004,144	3.06

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)

為替予約取引	アメリカドル	買建	1,932,623.78	282,243,235	282,437,910	0.18
	香港ドル	買建	20,000,000.00	372,180,000	372,558,000	0.23
	ブラジルレアル	売建	207,599.05	6,242,935	6,202,266	△0.00

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

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

≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2013年7月12日
作成基準日：2023年8月31日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	23,397円
純資産総額	176.93億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年1月	0円
2020年1月	0円
2021年1月	0円
2022年1月	0円
2023年1月	0円
設定来分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	43.3%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	2.3%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.8%
新興国株式インデックスマザーファンド	24.8%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	1.5%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	1.0%
外国債券インデックスマザーファンド	12.7%	T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.1%
		T 2.375% 05/15/27	アメリカ	国債	-	2.375%	2027/05/15	0.1%
新興国債券インデックスマザーファンド	8.5%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.2%
		BLTN 0% 01/01/26	ブラジル	国債	-	0.000%	2026/01/01	0.1%
国内株式インデックスマザーファンド	7.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.3%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.2%
国内債券インデックスマザーファンド	2.1%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.0%
		第150回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/12/20	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)

※2023年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。
受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

＜申込コース＞
当ファンドは、「分配金再投資コース」（※）専用ファンドです。
※「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

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

＜申込単位＞
1円以上1円単位とします。

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

＜申込手数料＞
ありません。

＜申込代金の支払い＞
販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞
収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。
ニューヨークの取引所の休業日
ロンドンの取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

＜申込受付の中止等＞
収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、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＞

1口以上1口単位とします。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（https://www.smtam.jp/）でご覧いただけます。

＜一部解約代金の支払い＞

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、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。

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

＜受付不可日＞

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

＜一部解約受付の中止等＞

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、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1万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①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。

②マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

③外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2013年 7月12日設定）

ただし、下記「(5)その他　＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞」の事項に該当する場合は、こ

の投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（4）【計算期間】

原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとします。
ただし、第1計算期間は2013年7月12日から2014年1月20日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

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

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

②収益分配金は、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則とし

て取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2022年1月21日から2023年1月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 （2022年 1月20日現在）	第10期 （2023年 1月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	115,537,939	129,561,817
親投資信託受益証券	10,994,601,343	12,948,923,733
未収入金	32,430,000	930,000
流動資産合計	11,142,569,282	13,079,415,550
資産合計	11,142,569,282	13,079,415,550
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,856,283	5,005,324
未払受託者報酬	2,402,153	2,846,624
未払委託者報酬	30,627,448	36,294,421
未払利息	173	50
その他未払費用	300,209	355,769
流動負債合計	37,186,266	44,502,188
負債合計	37,186,266	44,502,188
純資産の部		
元本等		
元本	5,555,620,315	6,626,603,018
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,549,762,701	6,408,310,344
（分配準備積立金）	2,462,260,075	2,461,322,552
元本等合計	11,105,383,016	13,034,913,362
純資産合計	11,105,383,016	13,034,913,362
負債純資産合計	11,142,569,282	13,079,415,550

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2021年 1月21日 至　2022年 1月20日	第10期 自　2022年 1月21日 至　2023年 1月20日
営業収益		
受取利息	639	525
有価証券売買等損益	1,234,137,971	△133,767,610
営業収益合計	1,234,138,610	△133,767,085
営業費用		
支払利息	46,454	55,821
受託者報酬	4,475,150	5,344,390
委託者報酬	57,058,121	68,140,894
その他費用	559,268	667,927
営業費用合計	62,138,993	74,209,032
営業利益又は営業損失（△）	1,171,999,617	△207,976,117
経常利益又は経常損失（△）	1,171,999,617	△207,976,117
当期純利益又は当期純損失（△）	1,171,999,617	△207,976,117
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（△）	111,807,167	3,197,494
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,663,833,208	5,549,762,701
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,389,662,984	1,614,753,893
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,389,662,984	1,614,753,893
剰余金減少額又は欠損金増加額	563,925,941	545,032,639
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	563,925,941	545,032,639
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	5,549,762,701	6,408,310,344

（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9期 (2022年 1月20日現在)	第10期 (2023年 1月20日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	5,555,620,315口	6,626,603,018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 1.9989円 (1万口当たり純資産額) (19,989円)	1口当たり純資産額 1.9671円 (1万口当たり純資産額) (19,671円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第9期 自 2021年 1月21日 至 2022年 1月20日	第10期 自 2022年 1月21日 至 2023年 1月20日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	187,130,180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	873,062,270円
収益調整金額	C	3,087,502,626円
分配準備積立金額	D	1,402,067,625円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,549,762,701円
当ファンドの期末残存口数	F	5,555,620,315口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,989円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	213,026,370円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円
収益調整金額	C	3,987,926,828円
分配準備積立金額	D	2,248,296,182円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,449,249,380円
当ファンドの期末残存口数	F	6,626,603,018口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,732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10期 自 2022年 1月21日 至 2023年 1月20日
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第10期 (2023年 1月20日現在)
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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9期 自 2021年 1月21日 至 2022年 1月20日	第10期 自 2022年 1月21日 至 2023年 1月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,783,837,430円	5,555,620,315円
期中追加設定元本額	1,489,212,801円	1,616,941,215円
期中一部解約元本額	717,429,916円	545,958,512円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第9期 (2022年 1月20日現在)	第10期 (2023年 1月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,150,276,496	△128,744,212
合計	1,150,276,496	△128,744,212

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス　マザーファンド	867,282,584	3,055,349,815	
	国内株式インデックス　マザーファンド	537,298,610	1,037,147,506	
	外国株式インデックス　マザーファンド	1,419,546,321	5,832,773,878	
	国内債券インデックス　マザーファンド	186,809,751	250,156,937	

	外国債券インデックス　マザーファンド	615,420,989	1,842,447,356	
	新興国債券インデックス　マザーファンド	514,732,553	931,048,241	
合計		4,141,090,808	12,948,923,733	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	341,254,424
国債証券	517,425,640,200
地方債証券	32,279,236,026
特殊債券	35,805,277,552
社債券	27,112,818,000
未収入金	572,278,800
未収利息	1,029,061,386
前払費用	27,848,318
流動資産合計	614,593,414,706
資産合計	614,593,414,706
負債の部	
流動負債	
未払金	300,783,000
未払解約金	330,660,849
未払利息	132
流動負債合計	631,443,981
負債合計	631,443,981
純資産の部	
元本等	
元本	458,486,364,988
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	155,475,605,737
元本等合計	613,961,970,725
純資産合計	613,961,970,725
負債純資産合計	614,593,414,706

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	458,486,364,988口
2．	担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
		有価証券　99,464,000円
3．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　1.3391円
		(1万口当たり純資産額)　(13,391円)

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

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	2023年 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2023年 1月20日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 1月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月21日
期首元本額	462,000,831,762円
期中追加設定元本額	41,971,742,256円
期中一部解約元本額	45,486,209,030円
期末元本額	458,486,364,988円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	4,216,590,150円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	15,992,721円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	20,828,567,326円
世界経済インデックスファンド	4,474,680,459円
ＤＣマイセレクション２５	26,492,233,516円
ＤＣマイセレクション５０	30,587,380,068円
ＤＣマイセレクション７５	9,173,506,828円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	427,729,787円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	91,252,806,556円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	65,126,080,268円
ＤＣマイセレクションＳ２５	13,843,731,749円
ＤＣマイセレクションＳ５０	15,476,859,759円
ＤＣマイセレクションＳ７５	3,552,121,149円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	680,069,386円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	2,368,936,357円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	901,782,215円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,647,598,836円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,358,293円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	26,997,148円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,397,367円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	979,351円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	75,767,706円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	107,462,272円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	30,772,282円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	24,072,703円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,518,901,671円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	718,627,692円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,007,141,096円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	64,919,215円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	50,856,804円

区分	2023年 1月20日現在
バランスD（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	931,432,253円
バランスE（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,041,689,868円
バランスF（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,357,962,014円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	134,416,893円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	5,571,025,390円
日本債券ファンド・シリーズ１	16,946,270,649円
分散投資コア戦略ファンドA	19,987,138,934円
分散投資コア戦略ファンドS	24,771,108,099円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	186,809,751円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,489,833,358円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	73,459,012円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	37,233,267円
SMT　インデックスバランス・オープン	59,243,192円
SMT　世界経済インデックス・オープン	45,156,031円
SMT　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	88,711,621円
SMT　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	142,957,127円
SMT　８資産インデックスバランス・オープン	13,032,560円
グローバル経済コア	235,061,622円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	36,238,981円
DCターゲット・イヤー　ファンド２０５５	22,008,452円
DCターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	40,324,858円
DCターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	22,762,948円
DCターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	6,101,198円
DCターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	4,857,354円
My　SMT　国内債券インデックス（ノーロード）	96,560,472円
１０資産分散投資ファンド	175,145円
ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	84,968,067,970円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	46,819,018円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	18,599,074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）	407,159,907円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2023年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△20,302,808,500
地方債証券	△857,815,284
特殊債券	△950,228,872
社債券	△787,031,000
合計	△22,897,883,656

(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４３３回利付国債（２年）	1,520,000,000	1,520,775,200	
	第４３４回利付国債（２年）	1,715,000,000	1,715,840,350	
	第４３５回利付国債（２年）	2,730,000,000	2,731,283,100	
	第４３６回利付国債（２年）	1,470,000,000	1,470,646,800	
	第４３７回利付国債（２年）	3,110,000,000	3,111,244,000	
	第４３８回利付国債（２年）	540,000,000	540,189,000	
	第４３９回利付国債（２年）	470,000,000	470,141,000	
	第４４０回利付国債（２年）	1,930,000,000	1,930,617,600	
	第４４１回利付国債（２年）	350,000,000	350,115,500	
	第４４２回利付国債（２年）	80,000,000	80,028,000	
	第４４３回利付国債（２年）	3,920,000,000	3,921,450,400	
	第４４４回利付国債（２年）	280,000,000	280,081,200	
	第１３９回利付国債（５年）	5,590,000,000	5,598,664,500	
	第１４０回利付国債（５年）	4,260,000,000	4,266,560,400	
	第１４１回利付国債（５年）	7,650,000,000	7,663,923,000	
	第１４２回利付国債（５年）	3,910,000,000	3,918,171,900	
	第１４３回利付国債（５年）	4,750,000,000	4,760,735,000	
	第１４４回利付国債（５年）	5,110,000,000	5,122,264,000	
	第１４５回利付国債（５年）	5,360,000,000	5,373,507,200	
	第１４６回利付国債（５年）	4,220,000,000	4,231,014,200	
	第１４７回利付国債（５年）	4,090,000,000	4,088,036,800	
	第１４８回利付国債（５年）	6,460,000,000	6,453,346,200	
	第１４９回利付国債（５年）	4,820,000,000	4,810,311,800	
	第１５０回利付国債（５年）	6,860,000,000	6,837,293,400	
	第１５１回利付国債（５年）	4,000,000,000	3,980,960,000	

第１５２回利付国債（５年）	210,000,000	209,825,700	
第１５３回利付国債（５年）	5,340,000,000	5,308,387,200	
第１５４回利付国債（５年）	5,740,000,000	5,724,042,800	
第１回利付国債（４０年）	400,000,000	477,964,000	
第２回利付国債（４０年）	1,130,000,000	1,300,562,200	
第３回利付国債（４０年）	650,000,000	750,087,000	
第４回利付国債（４０年）	950,000,000	1,095,720,500	
第５回利付国債（４０年）	1,070,000,000	1,186,940,300	
第６回利付国債（４０年）	1,260,000,000	1,360,396,800	
第７回利付国債（４０年）	1,240,000,000	1,276,394,000	
第８回利付国債（４０年）	1,490,000,000	1,420,685,200	
第９回利付国債（４０年）	2,260,000,000	1,570,451,400	
第１０回利付国債（４０年）	2,100,000,000	1,720,257,000	
第１１回利付国債（４０年）	1,525,000,000	1,201,837,250	
第１２回利付国債（４０年）	1,290,000,000	904,870,500	
第１３回利付国債（４０年）	2,120,000,000	1,475,180,800	
第１４回利付国債（４０年）	2,130,000,000	1,583,889,300	
第１５回利付国債（４０年）	1,910,000,000	1,548,379,700	
第３３３回利付国債（１０年）	4,110,000,000	4,140,085,200	
第３３４回利付国債（１０年）	4,260,000,000	4,296,508,200	
第３３５回利付国債（１０年）	2,310,000,000	2,329,519,500	
第３３６回利付国債（１０年）	1,210,000,000	1,221,761,200	
第３３７回利付国債（１０年）	2,800,000,000	2,816,548,000	
第３３８回利付国債（１０年）	4,560,000,000	4,599,763,200	
第３３９回利付国債（１０年）	4,670,000,000	4,714,925,400	
第３４０回利付国債（１０年）	4,430,000,000	4,476,470,700	
第３４１回利付国債（１０年）	5,020,000,000	5,062,268,400	
第３４２回利付国債（１０年）	4,760,000,000	4,771,995,200	
第３４３回利付国債（１０年）	2,670,000,000	2,675,900,700	
第３４４回利付国債（１０年）	5,900,000,000	5,908,555,000	
第３４５回利付国債（１０年）	3,780,000,000	3,781,436,400	
第３４６回利付国債（１０年）	5,750,000,000	5,745,227,500	
第３４７回利付国債（１０年）	3,550,000,000	3,543,752,000	
第３４８回利付国債（１０年）	4,260,000,000	4,248,157,200	
第３４９回利付国債（１０年）	4,930,000,000	4,909,589,800	
第３５０回利付国債（１０年）	6,390,000,000	6,355,749,600	代用有価証券 100,000,000円
第３５１回利付国債（１０年）	4,820,000,000	4,787,802,400	
第３５２回利付国債（１０年）	4,330,000,000	4,294,927,000	
第３５３回利付国債（１０年）	4,835,000,000	4,787,181,850	
第３５４回利付国債（１０年）	4,790,000,000	4,733,525,900	
第３５５回利付国債（１０年）	4,070,000,000	4,015,055,000	
第３５６回利付国債（１０年）	4,280,000,000	4,214,473,200	

第３５７回利付国債（１０年）	3,480,000,000	3,421,327,200	
第３５８回利付国債（１０年）	3,260,000,000	3,208,720,200	
第３５９回利付国債（１０年）	3,660,000,000	3,586,177,800	
第３６０回利付国債（１０年）	4,890,000,000	4,781,001,900	
第３６１回利付国債（１０年）	4,670,000,000	4,553,857,100	
第３６２回利付国債（１０年）	3,750,000,000	3,649,612,500	
第３６３回利付国債（１０年）	5,300,000,000	5,149,745,000	
第３６４回利付国債（１０年）	5,110,000,000	4,958,897,300	
第３６５回利付国債（１０年）	6,237,000,000	6,055,191,450	
第３６６回利付国債（１０年）	5,370,000,000	5,275,112,100	
第３６７回利付国債（１０年）	5,310,000,000	5,271,024,600	
第３６８回利付国債（１０年）	4,280,000,000	4,257,786,800	
第１回利付国債（３０年）	110,000,000	127,866,200	
第２回利付国債（３０年）	160,000,000	183,028,800	
第３回利付国債（３０年）	120,000,000	136,750,800	
第４回利付国債（３０年）	110,000,000	131,062,800	
第５回利付国債（３０年）	50,000,000	57,178,000	
第６回利付国債（３０年）	350,000,000	408,793,000	
第７回利付国債（３０年）	380,000,000	443,083,800	
第８回利付国債（３０年）	850,000,000	954,422,500	
第９回利付国債（３０年）	240,000,000	260,143,200	
第１０回利付国債（３０年）	160,000,000	168,624,000	
第１１回利付国債（３０年）	260,000,000	289,283,800	
第１２回利付国債（３０年）	190,000,000	219,206,800	
第１３回利付国債（３０年）	400,000,000	457,324,000	
第１４回利付国債（３０年）	800,000,000	949,040,000	
第１５回利付国債（３０年）	340,000,000	407,435,600	
第１６回利付国債（３０年）	200,000,000	239,834,000	
第１７回利付国債（３０年）	1,150,000,000	1,367,867,500	
第１８回利付国債（３０年）	315,000,000	371,448,000	
第１９回利付国債（３０年）	530,000,000	625,007,800	
第２０回利付国債（３０年）	480,000,000	577,771,200	
第２１回利付国債（３０年）	500,000,000	590,155,000	
第２２回利付国債（３０年）	540,000,000	650,797,200	
第２３回利付国債（３０年）	430,000,000	518,816,500	
第２４回利付国債（３０年）	780,000,000	940,937,400	
第２５回利付国債（３０年）	600,000,000	708,636,000	
第２６回利付国債（３０年）	1,390,000,000	1,659,034,500	
第２７回利付国債（３０年）	1,920,000,000	2,317,785,600	
第２８回利付国債（３０年）	2,220,000,000	2,679,340,200	
第２９回利付国債（３０年）	1,670,000,000	1,991,892,500	
第３０回利付国債（３０年）	1,770,000,000	2,082,741,300	

第３１回利付国債（３０年）	1,100,000,000	1,275,725,000	
第３２回利付国債（３０年）	1,460,000,000	1,714,054,600	
第３３回利付国債（３０年）	2,020,000,000	2,273,671,600	
第３４回利付国債（３０年）	1,665,000,000	1,926,105,300	
第３５回利付国債（３０年）	2,300,000,000	2,584,418,000	
第３６回利付国債（３０年）	2,130,000,000	2,395,376,700	
第３７回利付国債（３０年）	2,255,000,000	2,498,111,550	
第３８回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,534,827,300	
第３９回利付国債（３０年）	1,460,000,000	1,614,278,200	
第４０回利付国債（３０年）	1,130,000,000	1,228,004,900	
第４１回利付国債（３０年）	1,310,000,000	1,398,438,100	
第４２回利付国債（３０年）	1,310,000,000	1,396,931,600	
第４３回利付国債（３０年）	1,270,000,000	1,352,791,300	
第４４回利付国債（３０年）	1,200,000,000	1,276,800,000	
第４５回利付国債（３０年）	1,440,000,000	1,476,518,400	
第４６回利付国債（３０年）	1,800,000,000	1,842,894,000	
第４７回利付国債（３０年）	1,670,000,000	1,738,820,700	
第４８回利付国債（３０年）	1,740,000,000	1,742,992,800	
第４９回利付国債（３０年）	1,600,000,000	1,600,000,000	
第５０回利付国債（３０年）	1,630,000,000	1,433,911,000	
第５１回利付国債（３０年）	1,670,000,000	1,299,193,200	
第５２回利付国債（３０年）	1,660,000,000	1,352,418,600	
第５３回利付国債（３０年）	1,520,000,000	1,264,807,200	
第５４回利付国債（３０年）	1,720,000,000	1,495,918,400	
第５５回利付国債（３０年）	1,470,000,000	1,274,769,300	
第５６回利付国債（３０年）	1,550,000,000	1,340,223,000	
第５７回利付国債（３０年）	1,410,000,000	1,214,503,500	
第５８回利付国債（３０年）	2,280,000,000	1,958,109,600	
第５９回利付国債（３０年）	1,370,000,000	1,144,169,200	
第６０回利付国債（３０年）	1,420,000,000	1,242,571,000	
第６１回利付国債（３０年）	1,280,000,000	1,062,195,200	
第６２回利付国債（３０年）	340,000,000	266,614,400	
第６３回利付国債（３０年）	1,590,000,000	1,207,779,900	
第６４回利付国債（３０年）	1,760,000,000	1,331,721,600	
第６５回利付国債（３０年）	1,405,000,000	1,063,851,950	
第６６回利付国債（３０年）	1,110,000,000	837,250,800	
第６７回利付国債（３０年）	1,905,000,000	1,513,236,750	
第６８回利付国債（３０年）	1,490,000,000	1,180,541,900	
第６９回利付国債（３０年）	1,420,000,000	1,154,502,600	
第７０回利付国債（３０年）	2,260,000,000	1,833,153,800	
第７１回利付国債（３０年）	1,400,000,000	1,132,908,000	
第７２回利付国債（３０年）	1,150,000,000	929,292,000	
第７３回利付国債（３０年）	1,810,000,000	1,460,597,600	

第７４回利付国債（３０年）	1,740,000,000	1,523,352,600	
第７５回利付国債（３０年）	1,340,000,000	1,267,211,200	
第７６回利付国債（３０年）	1,960,000,000	1,896,398,000	
第６７回利付国債（２０年）	130,000,000	132,901,600	
第６８回利付国債（２０年）	190,000,000	194,898,200	
第６９回利付国債（２０年）	390,000,000	399,605,700	
第７０回利付国債（２０年）	400,000,000	413,548,000	
第７１回利付国債（２０年）	200,000,000	206,212,000	
第７２回利付国債（２０年）	630,000,000	652,031,100	
第７３回利付国債（２０年）	360,000,000	373,798,800	
第７４回利付国債（２０年）	200,000,000	208,048,000	
第７５回利付国債（２０年）	130,000,000	135,892,900	
第７６回利付国債（２０年）	270,000,000	281,075,400	
第７７回利付国債（２０年）	290,000,000	302,522,200	
第７８回利付国債（２０年）	170,000,000	177,769,000	
第７９回利付国債（２０年）	270,000,000	282,987,000	
第８０回利付国債（２０年）	220,000,000	231,112,200	
第８１回利付国債（２０年）	390,000,000	410,673,900	
第８２回利付国債（２０年）	600,000,000	633,396,000	
第８３回利付国債（２０年）	290,000,000	307,611,700	
第８４回利付国債（２０年）	470,000,000	497,175,400	
第８５回利付国債（２０年）	290,000,000	309,006,600	
第８６回利付国債（２０年）	510,000,000	546,643,500	
第８７回利付国債（２０年）	1,830,000,000	1,955,721,000	
第８８回利付国債（２０年）	420,000,000	452,356,800	
第８９回利付国債（２０年）	350,000,000	375,774,000	
第９０回利付国債（２０年）	630,000,000	679,196,700	
第９１回利付国債（２０年）	450,000,000	486,783,000	
第９２回利付国債（２０年）	880,000,000	949,044,800	
第９３回利付国債（２０年）	410,000,000	441,943,100	
第９４回利付国債（２０年）	610,000,000	660,050,500	
第９５回利付国債（２０年）	830,000,000	908,692,300	
第９６回利付国債（２０年）	1,590,000,000	1,726,819,500	
第９７回利付国債（２０年）	900,000,000	985,104,000	
第９８回利付国債（２０年）	440,000,000	479,569,200	
第９９回利付国債（２０年）	1,290,000,000	1,410,460,200	
第１００回利付国債（２０年）	480,000,000	529,099,200	
第１０１回利付国債（２０年）	715,000,000	795,437,500	
第１０２回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,317,765,000	
第１０３回利付国債（２０年）	400,000,000	444,560,000	
第１０４回利付国債（２０年）	160,000,000	176,115,200	
第１０５回利付国債（２０年）	1,180,000,000	1,302,861,600	

第１０６回利付国債（２０年）	380,000,000	421,689,800	
第１０７回利付国債（２０年）	700,000,000	775,152,000	
第１０８回利付国債（２０年）	840,000,000	920,404,800	
第１０９回利付国債（２０年）	520,000,000	570,954,800	
第１１０回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,221,099,000	
第１１１回利付国債（２０年）	970,000,000	1,085,818,000	
第１１２回利付国債（２０年）	790,000,000	879,364,800	
第１１３回利付国債（２０年）	2,020,000,000	2,255,107,800	
第１１４回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,608,481,600	
第１１５回利付国債（２０年）	700,000,000	788,389,000	
第１１６回利付国債（２０年）	1,490,000,000	1,685,890,300	
第１１７回利付国債（２０年）	1,080,000,000	1,214,438,400	
第１１８回利付国債（２０年）	660,000,000	738,335,400	
第１１９回利付国債（２０年）	530,000,000	585,045,800	
第１２０回利付国債（２０年）	1,570,000,000	1,710,420,800	
第１２１回利付国債（２０年）	1,470,000,000	1,636,859,700	
第１２２回利付国債（２０年）	940,000,000	1,039,705,800	
第１２３回利付国債（２０年）	1,820,000,000	2,057,127,800	
第１２４回利付国債（２０年）	610,000,000	684,804,300	
第１２５回利付国債（２０年）	1,770,000,000	2,019,959,400	
第１２６回利付国債（２０年）	730,000,000	821,250,000	
第１２７回利付国債（２０年）	1,020,000,000	1,139,452,200	
第１２８回利付国債（２０年）	970,000,000	1,086,545,500	
第１２９回利付国債（２０年）	740,000,000	822,909,600	
第１３０回利付国債（２０年）	1,985,000,000	2,211,984,750	
第１３１回利付国債（２０年）	1,000,000,000	1,106,000,000	
第１３２回利付国債（２０年）	660,000,000	731,583,600	
第１３３回利付国債（２０年）	730,000,000	815,439,200	
第１３４回利付国債（２０年）	430,000,000	481,243,100	
第１３５回利付国債（２０年）	630,000,000	699,230,700	
第１３６回利付国債（２０年）	1,050,000,000	1,156,155,000	
第１３７回利付国債（２０年）	1,060,000,000	1,178,497,400	
第１３８回利付国債（２０年）	620,000,000	677,821,200	
第１３９回利付国債（２０年）	830,000,000	915,299,100	
第１４０回利付国債（２０年）	2,420,000,000	2,693,726,200	
第１４１回利付国債（２０年）	1,600,000,000	1,781,232,000	
第１４２回利付国債（２０年）	980,000,000	1,100,255,800	
第１４３回利付国債（２０年）	1,920,000,000	2,117,932,800	
第１４４回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,202,795,000	
第１４５回利付国債（２０年）	2,675,000,000	2,976,285,250	
第１４６回利付国債（２０年）	2,940,000,000	3,270,485,400	
第１４７回利付国債（２０年）	2,260,000,000	2,488,802,400	
第１４８回利付国債（２０年）	1,870,000,000	2,037,402,400	

	第１４９回利付国債（２０年）	2,600,000,000	2,830,152,000	
	第１５０回利付国債（２０年）	2,680,000,000	2,885,288,000	
	第１５１回利付国債（２０年）	2,635,000,000	2,773,706,400	
	第１５２回利付国債（２０年）	3,130,000,000	3,290,537,700	
	第１５３回利付国債（２０年）	2,560,000,000	2,716,697,600	
	第１５４回利付国債（２０年）	2,745,000,000	2,876,156,100	
	第１５５回利付国債（２０年）	2,950,000,000	3,013,720,000	
	第１５６回利付国債（２０年）	2,270,000,000	2,144,060,400	
	第１５７回利付国債（２０年）	2,930,000,000	2,683,030,300	
	第１５８回利付国債（２０年）	2,420,000,000	2,298,056,200	
	第１５９回利付国債（２０年）	2,390,000,000	2,292,870,400	
	第１６０回利付国債（２０年）	1,850,000,000	1,792,298,500	
	第１６１回利付国債（２０年）	2,070,000,000	1,970,702,100	
	第１６２回利付国債（２０年）	1,230,000,000	1,166,347,500	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,320,000,000	2,191,077,600	
	第１６４回利付国債（２０年）	1,500,000,000	1,390,320,000	
	第１６５回利付国債（２０年）	2,150,000,000	1,983,977,000	
	第１６６回利付国債（２０年）	1,850,000,000	1,753,485,500	
	第１６７回利付国債（２０年）	2,210,000,000	2,022,260,500	
	第１６８回利付国債（２０年）	1,610,000,000	1,442,543,900	
	第１６９回利付国債（２０年）	1,990,000,000	1,744,493,700	
	第１７０回利付国債（２０年）	2,740,000,000	2,389,362,200	
	第１７１回利付国債（２０年）	1,720,000,000	1,492,977,200	
	第１７２回利付国債（２０年）	2,330,000,000	2,048,792,300	
	第１７３回利付国債（２０年）	2,350,000,000	2,057,096,000	
	第１７４回利付国債（２０年）	2,800,000,000	2,439,836,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	2,030,000,000	1,794,093,700	
	第１７６回利付国債（２０年）	2,740,000,000	2,412,734,400	
	第１７７回利付国債（２０年）	2,310,000,000	1,989,395,100	
	第１７８回利付国債（２０年）	2,120,000,000	1,854,194,400	
	第１７９回利付国債（２０年）	2,765,000,000	2,410,997,050	
	第１８０回利付国債（２０年）	2,360,000,000	2,172,380,000	
	第１８１回利付国債（２０年）	1,690,000,000	1,581,552,700	
	第１８２回利付国債（２０年）	2,400,000,000	2,324,832,000	
国債証券合計		518,857,000,000	517,425,640,200	
地方債証券	第２回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（５年））	100,000,000	99,535,000	
	第３回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	102,512,000	
	第５回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年））	100,000,000	78,984,000	
	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	104,057,000	
	第９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	116,403,000	
	第１１回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	113,369,000	

第１３回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	109,145,000	
第１５回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	106,341,000	
第１６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	218,468,000	
第１７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	109,695,000	
第１９回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	110,388,000	
第１９回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	79,194,000	
第２６回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	220,358,000	
第２７回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	218,170,000	
第３３回東京都公募公債（５年）	200,000,000	199,274,000	
第７５１回東京都公募公債	100,000,000	100,681,000	
第７６５回東京都公募公債	100,000,000	99,856,000	
第７７０回東京都公募公債	100,000,000	99,604,000	
第７８１回東京都公募公債	300,000,000	296,739,000	
第８００回東京都公募公債	200,000,000	194,128,000	
第８３０回東京都公募公債	300,000,000	290,961,000	
平成２７年度第１５回北海道公募公債	100,000,000	100,243,000	
平成２８年度第１回北海道公募公債	100,000,000	99,779,000	
平成２８年度第１４回北海道公募公債	100,000,000	99,974,000	
平成３０年度第１４回北海道公募公債	200,000,000	197,404,000	
第３１回１号宮城県公募公債（１０年）	200,000,000	202,064,000	
第４回神奈川県公募公債（３０年）	200,000,000	240,104,000	
第１１回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	110,098,000	
第１５回神奈川県公募公債（２０年）	200,000,000	220,362,000	
第１７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	110,929,000	
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	109,877,000	
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	100,000,000	105,816,000	
第７８回神奈川県公募公債（５年）	200,000,000	199,688,000	
第２１０回神奈川県公募公債	200,000,000	201,284,000	
第２１５回神奈川県公募公債	100,000,000	100,887,000	
第２１８回神奈川県公募公債	100,000,000	100,173,000	
第２２６回神奈川県公募公債	100,000,000	99,794,000	
第２２７回神奈川県公募公債	100,000,000	99,604,000	
第２４３回神奈川県公募公債	200,000,000	194,062,000	
第６回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	220,782,000	
第７回大阪府公募公債（２０年）	200,000,000	219,960,000	
第１０回大阪府公募公債（２０年）	100,000,000	110,347,000	
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,717,000	
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	151,000,000	152,038,880	
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,021,000	
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	101,002,000	
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	156,000,000	155,680,200	
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	198,748,000	

第４３９回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	197,382,000	
第４４０回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	98,576,000	
第４６５回大阪府公募公債（１０年）	160,000,000	153,654,400	
第４６８回大阪府公募公債（１０年）	182,000,000	174,503,420	
第４６９回大阪府公募公債（１０年）	200,000,000	191,672,000	
平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	110,992,000	
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	109,722,000	
平成２７年度第４回京都府公募公債	100,000,000	101,040,000	
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	91,284,000	
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	100,000,000	93,662,000	
令和２年度第１２回京都府公募公債	140,500,000	135,359,105	
第２回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	109,630,000	
第３回兵庫県公募公債（１２年）	100,000,000	100,979,000	
第６回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	105,238,000	
第７回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	104,109,000	
第８回兵庫県公募公債（１５年）	100,000,000	103,883,000	
第９回兵庫県公募公債（２０年）	400,000,000	446,212,000	
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	100,000,000	100,721,000	
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	91,782,000	
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	300,000,000	292,581,000	
第１回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	105,440,000	
第９回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	100,393,000	
第１２回静岡県公募公債（３０年）	100,000,000	83,569,000	
第１５回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	109,995,000	
第１８回静岡県公募公債（２０年）	100,000,000	106,683,000	
平成２６年度第３回静岡県公募公債	100,000,000	100,765,000	
平成２９年度第５回静岡県公募公債	100,000,000	99,647,000	
平成２９年度第８回静岡県公募公債	100,000,000	99,734,000	
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	100,000,000	99,678,000	
令和２年度第１１回静岡県公募公債	310,000,000	300,718,600	
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	111,356,000	
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,718,000	
平成２６年度第５回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	201,482,000	
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	100,742,000	
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,692,000	
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	199,504,000	
	300,000,000	278,808,000	

平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）			
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	99,148,000	
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	100,000,000	82,377,000	
令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	194,268,000	
令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	96,988,000	
令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年）	200,000,000	157,246,000	
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	100,000,000	110,893,000	
平成２１年度第１回広島県公募公債（２０年）	200,000,000	221,684,000	
平成２７年度第４回広島県公募公債	125,230,000	126,458,506	
平成２９年度第１回広島県公募公債	100,000,000	99,632,000	
令和２年度第７回広島県公募公債	390,000,000	377,551,200	
令和４年度第２回広島県公募公債	100,000,000	97,950,000	
第３回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	109,406,000	
第６回埼玉県公募公債（２０年）	100,000,000	110,449,000	
第６回埼玉県公募公債（３０年）	100,000,000	87,738,000	
第７回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	222,854,000	
第８回埼玉県公募公債（１５年）	200,000,000	184,678,000	
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	220,362,000	
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	200,000,000	183,338,000	
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	100,000,000	100,659,000	
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	100,975,000	
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	99,615,000	
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	100,000,000	100,051,000	
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	100,000,000	99,646,000	
令和２年度第７回埼玉県公募公債	100,000,000	96,599,000	
令和２年度第８回埼玉県公募公債	100,000,000	96,340,000	
令和３年度第８回埼玉県公募公債	150,000,000	143,595,000	
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	109,542,000	
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	109,464,000	
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	104,350,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	111,069,000	
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	104,913,000	
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	112,206,000	
平成２６年度第８回福岡県公募公債	100,000,000	100,627,000	
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	103,927,000	

平成２７年度第７回福岡県公募公債	100,000,000	100,960,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	100,000,000	82,377,000	
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	92,285,000	
令和２年度第１回福岡県公募公債	300,000,000	291,456,000	
令和３年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	96,198,000	
令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	91,074,000	
第５回千葉県公募公債（２０年）	200,000,000	220,898,000	
第６回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	111,026,000	
第１３回千葉県公募公債（２０年）	100,000,000	109,995,000	
平成２６年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	100,655,000	
平成２７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	100,998,000	
平成２８年度第４回千葉県公募公債	100,000,000	99,616,000	
平成２８年度第６回千葉県公募公債	120,000,000	119,770,800	
令和元年度第７回千葉県公募公債	300,000,000	291,165,000	
令和２年度第７回千葉県公募公債	100,000,000	96,844,000	
平成２７年度第１回新潟県公募公債	100,000,000	100,983,000	
令和３年度第１回長野県公募公債（１０年）	300,000,000	289,671,000	
令和４年度第１回長野県公募公債（１０年）	300,000,000	291,060,000	
第１回群馬県公募公債（２０年）	200,000,000	218,812,000	
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	100,000,000	99,587,000	
第１３１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,620,000	
第１３２回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,989,000	
第１３４回共同発行市場公募地方債	112,000,000	112,852,320	
第１３５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,775,000	
第１３６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,747,000	
第１３７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,715,000	
第１３９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,754,000	
第１４０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,436,000	
第１４５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,286,000	
第１４６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,016,000	
第１４８回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,741,780	
第１５２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,037,000	
第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,890,000	
第１５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,795,000	
第１５９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,386,000	
第１６０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,162,000	
第１６１回共同発行市場公募地方債	400,000,000	398,284,000	
第１６４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,389,000	
第１６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,809,000	
第１６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,035,000	
第１７１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,248,000	

第１７４回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,046,765	
第１７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,634,000	
第１８１回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,369,000	
第２１９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,051,000	
第２２８回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,056,000	
第２３３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	195,008,000	
令和４年度第３回長崎県公募公債（１０年）	100,000,000	97,820,000	
平成２９年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	99,612,000	
平成３０年度第１回浜松市公募公債	100,000,000	98,342,000	
第１３回大阪市公募公債（２０年）	200,000,000	221,946,000	
第１５回大阪市公募公債（３０年）	100,000,000	78,364,000	
第２２回大阪市公募公債（２０年）	300,000,000	275,802,000	
第２４回大阪市公募公債（２０年）	100,000,000	94,528,000	
平成２５年度第８回大阪市公募公債	100,000,000	100,699,000	
令和３年度第２回大阪市公募公債	200,000,000	192,494,000	
第１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	118,483,000	
第５回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	118,192,000	
第９回名古屋市公募公債（２０年）	100,000,000	109,580,000	
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	100,000,000	105,176,000	
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	99,917,000	
第５１２回名古屋市公募公債（１０年）	300,000,000	291,462,000	
平成２８年度第６回京都市公募公債	200,000,000	199,618,000	
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	120,000,000	129,729,600	
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	200,000,000	221,290,000	
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	111,743,000	
平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年）	100,000,000	109,385,000	
令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	78,323,000	
令和３年度第６回神戸市公募公債（３０年）	100,000,000	78,531,000	
第５回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	104,933,000	
第２０回横浜市公募公債（２０年）	300,000,000	331,452,000	
平成２８年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	99,789,000	
平成２９年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	99,864,000	
平成３０年度第１回横浜市公募公債	100,000,000	99,229,000	
平成３０年度第４回横浜市公募公債	100,000,000	99,431,000	
第３０回横浜市公募公債（２０年）	200,000,000	211,014,000	
令和２年度第１回横浜市公募公債	300,000,000	291,474,000	
令和３年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	96,245,000	
平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	100,000,000	105,074,000	
平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	100,601,000	

	第１１回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	109,399,000	
	第８９回川崎市公募公債	100,000,000	99,767,000	
	第９３回川崎市公募公債	100,000,000	96,520,000	
	平成２６年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	100,626,000	
	平成２７年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	100,996,000	
	平成２８年度第１回北九州市公募公債	100,000,000	99,779,000	
	平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	110,661,000	
	平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年）	100,000,000	107,250,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	200,000,000	201,496,000	
	平成２５年度第３回広島市公募公債	150,000,000	150,946,500	
	平成２６年度第２回広島市公募公債	100,000,000	100,656,000	
	平成２８年度第４回広島市公募公債	105,000,000	104,776,350	
	平成２９年度第６回広島市公募公債	170,000,000	169,138,100	
	令和元年度第６回広島市公募公債	550,000,000	535,122,500	
	令和２年度第３回広島市公募公債（５年）	300,000,000	299,091,000	
	令和元年度第５回千葉市公募公債	200,000,000	194,110,000	
	令和３年度第８回千葉市公募公債	300,000,000	288,342,000	
	令和４年度第１回千葉市公募公債	100,000,000	96,802,000	
	平成２５年度第４回福井県公募公債	100,000,000	100,755,000	
	平成２７年度第１回山梨県公募公債（１０年）	100,000,000	101,009,000	
	平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	200,000,000	200,866,000	
	平成３０年度第３回岡山県公募公債（１０年）	100,000,000	98,196,000	
	第１１３回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	109,421,000	
地方債証券合計		32,011,430,000	32,279,236,026	
特殊債券	第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,651,000	
	第５２回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,850,000	
	第７８回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,561,000	
	第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	66,486,000	
	第２０回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,162,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	118,572,000	
	第２７回道路債券	400,000,000	410,624,000	
	第２８回道路債券	200,000,000	239,050,000	
	第３３回道路債券	200,000,000	241,556,000	
	第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,958,000	
	第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,699,000	

第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,464,000	
第４２回道路債券	100,000,000	104,441,000	
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,430,000	
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	117,932,000	
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	221,814,000	
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	223,496,000	
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,734,000	
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	114,293,000	
第１２３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,659,000	
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	112,137,000	
第１２５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,630,000	
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,926,000	
第１３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,548,000	
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,641,000	
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,001,000	
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,076,000	
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	110,089,000	
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	555,576,000	
第１９６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,853,000	
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	82,847,000	
第２０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	533,000,000	536,805,620	
第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,097,000	
第２１４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,996,000	
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	102,790,500	
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	100,815,000	
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	100,801,000	
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	212,850,000	

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	100,823,000	
第２３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	259,000,000	260,955,450	
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	301,485,000	
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	103,524,000	
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	208,326,000	
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	201,372,000	
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	100,166,000	
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	78,546,000	
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	106,322,690	
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	204,403,450	
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	99,750,000	
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	199,360,000	
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	99,611,000	
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	119,390,400	
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	198,158,000	
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	277,800,000	
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	212,469,900	
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	97,460,000	
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	97,129,000	
第４０３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	116,456,400	
第２回公営企業債券（３０年）	300,000,000	345,963,000	
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	100,000,000	103,987,000	
第５回公営企業債券（３０年）	300,000,000	358,317,000	
第７回公営企業債券（２０年）	100,000,000	102,442,000	
第７回公営企業債券（３０年）	200,000,000	238,396,000	
第８回公営企業債券（２０年）	40,000,000	41,000,000	
第８回公営企業債券（３０年）	100,000,000	117,288,000	
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	220,830,000	
第１０回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	216,706,000	
	600,000,000	599,286,000	

第１１回政府保証地方公共団体金融機構債券（４年）			
第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年）	200,000,000	151,514,000	
第１８回公営企業債券（２０年）	100,000,000	108,079,000	
第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	200,000,000	219,410,000	
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	100,000,000	109,967,000	
第３４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	500,000,000	539,880,000	
第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	704,606,000	
第５８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,682,000	
第５８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,743,000	
第６５回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,145,000	
第６７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,715,000	
第６９回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,708,000	
第７６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,868,000	
Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,498,000	
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,833,000	
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,763,000	
第８３回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,428,000	
第８８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,451,000	
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,651,000	
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	250,259,550	
Ｆ９５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,439,000	
第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,664,000	
第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,637,000	
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,468,700	
Ｆ１０７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,683,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	154,948,560	
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,317,000	
第１１６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,970,000	
第１１９回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,556,000	
第１２０回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,420,000	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,362,000	
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,400,000	
Ｆ２０２回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,000,000	
Ｆ２０６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,284,000	
Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,086,000	
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,608,000	
Ｆ２２６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,520,000	

Ｆ４４１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,317,000	
第２９回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,056,000	
第７回阪神高速道路債券	100,000,000	104,264,000	
第２７回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,448,000	
第１９回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,468,000	
第４回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	110,558,000	
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	111,667,000	
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,701,380	
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,663,000	
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,498,500	
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	185,683,520	
第５４回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,711,800	
第８７回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	199,738,000	
第８９回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,731,000	
第１１７回都市再生債券	200,000,000	202,134,000	
第１５９回都市再生債券	200,000,000	125,712,000	
第１６１回都市再生債券	100,000,000	69,632,000	
第１７１回都市再生債券	200,000,000	148,178,000	
第５回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,912,000	
第６２回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	96,919,000	
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	9,904,000	9,943,120	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	117,780,000	116,833,048	
第３回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,959,000	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	80,656,000	79,953,486	
第４回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	108,172,000	
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,705,000	10,820,935	
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	141,612,000	139,888,581	
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	10,555,000	10,664,349	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	164,157,000	161,807,913	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	58,512,000	57,772,993	
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,062,000	11,232,022	
第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	201,765,000	198,254,289	
第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	138,624,000	136,381,063	
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	11,112,000	11,305,793	
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,185,000	

第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,718,000	15,362,059	
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,536,000	15,199,713	
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,603,000	17,463,699	
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,628,000	19,539,095	
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,982,000	21,016,867	
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,571,000	21,592,144	
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,464,000	44,493,779	
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,386,000	20,229,872	
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,722,000	20,576,159	
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,363,000	20,223,104	
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,299,000	19,098,300	
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,769,000	10,906,735	
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,674,000	40,148,252	
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,244,000	21,025,215	
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,458,000	10,568,645	
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,069,000	28,021,016	
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,848,000	26,756,298	
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,001,000	26,954,976	
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,622,000	58,524,499	
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,602,000	71,312,817	
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,018,000	36,847,494	
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,003,000	38,161,193	
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,387,000	38,597,217	
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,787,000	33,803,069	
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,048,000	32,793,756	
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,382,000	38,650,371	
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	166,614,000	
第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,161,000	99,428,737	
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,512,000	134,506,528	
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,095,000	38,835,566	
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,578,000	40,354,520	
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,166,000	40,819,500	
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,878,000	
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,125,000	129,057,300	
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,497,000	43,977,641	
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,366,000	92,616,311	
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,484,000	51,733,182	
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,272,000	55,301,846	
第９６回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	315,609,000	
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,643,000	54,942,443	
第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,704,000	171,139,695	
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,358,000	115,102,470	

第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,605,000	55,847,437	
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,958,000	60,138,473	
第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,395,000	64,419,748	
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,994,000	69,969,528	
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,500,000	69,289,935	
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,995,000	70,019,457	
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,407,000	70,706,883	
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,846,000	70,982,599	
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,549,000	72,426,589	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,038,000	72,950,442	
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,949,000	72,647,316	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,889,000	72,585,414	
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,730,000	73,402,059	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,584,000	148,483,475	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,754,000	73,376,839	
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,060,000	150,445,414	
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,053,000	74,572,663	
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,292,000	148,975,097	
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,978,000	75,383,671	
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,314,000	151,620,806	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,600,000	152,804,756	
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,705,000	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,807,000	77,295,473	
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,400,000	77,075,168	
第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,602,000	76,558,815	
第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,342,000	157,198,053	
第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,451,000	78,749,774	

第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,552,000	78,009,381	
第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,758,000	158,177,886	
第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,283,000	79,786,501	
第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	254,250,000	239,312,812	
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,896,000	160,778,956	
第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,853,000	82,796,096	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,719,000	83,339,190	
第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,182,000	171,929,664	
第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,153,000	86,808,648	
第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,554,000	173,756,722	
第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,206,000	174,934,912	
第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,461,000	87,161,418	
第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,116,000	176,158,506	
第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,960,000	176,658,995	
第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,308,000	88,999,036	
第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,758,000	89,757,620	
第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	284,058,000	268,985,882	
第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,106,000	90,148,124	
第１７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,251,000	92,464,485	
第１８１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,518,000	93,704,071	
第１８３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,407,000	94,682,295	
第１８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,884,000	189,865,740	
第１８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,862,000	97,956,633	
第１８８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,138,000	
第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	88,934,000	
第３２０回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	77,325,000	
第６回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	104,507,000	
第２４回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	599,574,000	

	い第８２９号商工債	200,000,000	199,898,000	
	い第８３２号商工債	200,000,000	199,646,000	
	い第８３３号商工債	100,000,000	99,789,000	
	い第８４３号商工債	200,000,000	199,610,000	
	い第８４７号商工債	100,000,000	99,651,000	
	い第８５０号商工債	200,000,000	199,180,000	
	第３６０回信金中金債（５年）	200,000,000	199,426,000	
	第３７６回信金中金債（５年）	100,000,000	99,542,000	
	第３７９回信金中金債（５年）	100,000,000	99,387,000	
	第３８５回信金中金債（５年）	100,000,000	99,068,000	
	第２５４号商工債（３年）	300,000,000	299,661,000	
	第２回信金中金債（１０年）	100,000,000	100,880,000	
	第２１回国際協力機構債券	100,000,000	108,710,000	
	第６４回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	96,884,000	
	第６７回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	194,680,000	
	第７３回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	483,850,000	
	第８６回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,728,000	
	第８５回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,098,000	
	第２７回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,846,000	
	第５４回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	597,906,000	
	第６６回西日本高速道路株式会社社債	800,000,000	799,200,000	
	第７０回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,454,000	
	第７１回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,407,000	
	第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,361,000	
	第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	186,986,000	
特殊債券合計		35,643,776,000	35,805,277,552	
社債券	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	99,426,000	
	第２９回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	300,000,000	297,852,000	
	第２回Ｂ・Ｐ・Ｃ・Ｅ・Ｓ・Ａ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,454,000	
	第８回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	98,701,000	
	第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,163,000	
	第１３回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,589,000	
	第１回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債	400,000,000	395,356,000	
	第３９回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,182,000	
	第２４回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,953,000	
	第１１回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,316,000	
	第８回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,037,000	

第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,402,000	
第２５回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,588,000	
第２９回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,796,000	
第２回ＤＭ三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
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	99,971,000	
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	100,006,000	
第１０回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,700,000	
第１９回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	197,874,000	
第８回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,193,000	
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,795,000	
第６回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,509,000	
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	98,357,000	
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	98,372,000	
第１４回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,166,000	
第１３回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,652,000	
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	98,734,000	
第２５回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,515,000	
第１３回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,428,000	
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,434,000	
第１３回ＪＳＲ株式会社無担保社債	100,000,000	98,999,000	
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	98,712,000	
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	197,508,000	
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	199,434,000	
第４０回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,035,000	
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	85,000,000	
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,817,000	
第４回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,855,000	
第６回株式会社電通無担保社債	200,000,000	196,220,000	
第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	282,426,000	
第１回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
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	99,722,000	
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,369,000	
第１５回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	97,348,000	

第１９回楽天グループ株式会社無担保社債	100,000,000	78,416,000	
第１０回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,605,000	
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,104,000	
第４回ＥＮＥＯＳホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,441,000	
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,736,000	
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,210,000	
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,712,000	
第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,126,000	
第１１回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	99,595,000	
第２回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,578,000	
第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,637,000	
第１５回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,246,000	
第３４回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,112,000	
第１４回株式会社ＬＩＸＩＬ無担保社債	100,000,000	99,227,000	
第８回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,388,000	
第１７回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	104,359,000	
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	97,314,000	
第１回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,357,000	
第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,706,000	
第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,861,000	
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	199,888,000	
第２１回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,451,000	
第２３回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	95,896,000	
第３７回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,914,000	
第１８回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,072,000	
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,640,000	
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,190,000	
第２２回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,247,000	
第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,489,000	
第２７回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	192,876,000	
第４回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,736,000	
第８回楽天カード株式会社無担保社債	100,000,000	93,030,000	
第１回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,303,000	
第６回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	85,854,000	
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,722,000	
第１０８回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,069,000	
第７０回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	110,874,000	
第７３回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	195,108,000	
第５３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,973,000	

第５６回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,533,000	
第６０回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	97,478,000	
第３回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,800,000	
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	97,176,000	
第２４回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	98,867,000	
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	112,492,000	
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	107,804,000	
第１回三井住友ＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,450,000	
第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,490,000	
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	301,449,000	
第９回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	96,755,000	
第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,252,000	
第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	194,746,000	
第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,123,000	
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,376,000	
第７６回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,554,000	
第７８回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,699,000	
第９８回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,890,000	
第４１回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,805,000	
第１６回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,248,000	
第１７回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	98,811,000	
第３０回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,155,000	
第３２回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,773,000	
第３５回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,406,000	
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,553,000	
第８０回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,209,000	
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	200,000,000	197,792,000	
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,909,000	
第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,373,000	
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	98,607,000	

第３回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,254,000	
第４回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,232,000	
第５回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,556,000	
第７回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	197,934,000	
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,504,000	
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,766,000	
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	86,477,000	
第１３５回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,000,000	
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,811,000	
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,833,000	
第１０９回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,334,000	
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,843,000	
第１３２回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	97,905,000	
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	82,779,000	
第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,306,000	
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,649,000	
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	86,959,000	
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	78,065,000	
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,626,000	
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,976,000	
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,488,000	
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	220,204,000	
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,889,000	
第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	86,378,000	
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	81,221,000	
第１４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,780,000	
第１５９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	77,081,000	
第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	84,349,000	
第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	72,796,000	
第１８４回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,187,000	
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,483,000	
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	76,465,000	
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	84,480,000	
第５９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	498,255,000	

第７５回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	84,085,000	
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,422,000	
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,130,000	
第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,336,000	
第３１回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	81,785,000	
第３７回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	69,193,000	
第４０回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	63,622,000	
第５４回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	74,384,000	
第５６回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	82,816,000	
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	156,586,000	
第６回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	99,290,000	
第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	98,540,000	
第３０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	99,974,000	
第１１回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	395,776,000	
第３１回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	167,200,000	
第３３回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	88,981,000	
第３６回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	87,644,000	
第５０７回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,570,000	
第５１１回中部電力株式会社社債	100,000,000	98,898,000	
第５１９回中部電力株式会社社債	100,000,000	92,372,000	
第５４０回中部電力株式会社社債	100,000,000	83,027,000	
第５０８回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,171,000	
第５１０回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,292,000	
第５１１回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,715,000	
第５２４回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,995,000	
第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	94,823,000	
第５３８回関西電力株式会社社債	100,000,000	94,262,000	
第５５０回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,796,000	
第５５４回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,836,000	
第３９８回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,035,000	
第４００回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,551,000	
第４１６回中国電力株式会社社債	200,000,000	193,106,000	
第４２５回中国電力株式会社社債	100,000,000	95,524,000	
第３０７回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,990,000	
第３２２回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,005,000	
第３３０回北陸電力株式会社社債	200,000,000	192,926,000	
第４９６回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,663,000	
第５０８回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,177,000	
第５２１回東北電力株式会社社債	200,000,000	192,146,000	
第５２７回東北電力株式会社社債	100,000,000	93,792,000	

	第５３５回東北電力株式会社社債	100,000,000	96,745,000	
	第３０９回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,896,000	
	第３１４回四国電力株式会社社債	100,000,000	93,475,000	
	第４４９回九州電力株式会社社債	200,000,000	197,726,000	
	第４６５回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,488,000	
	第４６８回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,725,000	
	第４８４回九州電力株式会社社債	200,000,000	191,724,000	
	第４８９回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,777,000	
	第４９４回九州電力株式会社社債	100,000,000	93,308,000	
	第３４０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,070,000	
	第３５０回北海道電力株式会社社債	100,000,000	89,026,000	
	第４４回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	90,101,000	
	第５０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,872,000	
	第５７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,400,000	
	第７７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,888,000	
	第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	194,898,000	
	第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,354,000	
	第４１回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	296,283,000	
	第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,275,000	
	第４４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,420,000	
	第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	94,478,000	
	第４８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	260,934,000	
	第５５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,332,000	
	第５８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,133,000	
	第９回株式会社ＪＥＲＡ無担保社債	100,000,000	94,305,000	
	第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	77,556,000	
	第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,664,000	
	第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	189,960,000	
	第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	84,159,000	
	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	198,224,000	
社債券合計		28,000,000,000	27,112,818,000	
合計			612,622,971,778	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,324,470,853
株式	500,699,054,270
派生商品評価勘定	37,473,150
未収入金	885,588,576
未収配当金	865,025,555
差入委託証拠金	125,875,800
流動資産合計	504,937,488,204
資産合計	504,937,488,204
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	226,650
前受金	37,258,600
未払解約金	1,429,313,035
未払利息	905
流動負債合計	1,466,799,190
負債合計	1,466,799,190
純資産の部	
元本等	
元本	260,822,185,787
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	242,648,503,227
元本等合計	503,470,689,014
純資産合計	503,470,689,014
負債純資産合計	504,937,488,204

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月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。

	2023年 1月20日現在
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）

		2023年 1月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	260,822,185,787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 1.9303円 (1万口当たり純資産額) (19,303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

	2023年 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。

	2023年 1月20日現在
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 1月20日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2023年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月21日
期首元本額	254,903,427,075円
期中追加設定元本額	31,158,361,913円
期中一部解約元本額	25,239,603,201円
期末元本額	260,822,185,787円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	379,722,200円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	4,091,941,634円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	14,347,857円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	11,993,311,741円
世界経済インデックスファンド	4,527,869,495円
日本株式インデックス・オープン	3,225,514,441円
ＤＣマイセレクション２５	6,161,086,279円
ＤＣマイセレクション５０	19,056,918,948円
ＤＣマイセレクション７５	19,465,160,148円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	6,250,299,193円
ＤＣマイセレクションＳ２５	3,251,989,076円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,588,540,932円
ＤＣマイセレクションＳ７５	7,470,728,844円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	8,718,962,796円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	159,664,689円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	693,739,354円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	519,347,559円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,864,346,739円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,322,023,875円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,252,143円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	16,503,636円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	15,793,533円
日本株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	170,487,432円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	25,051,962円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	94,669,650円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	22,513,920円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	60,370,555円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	770,395,001円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	408,144,273円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,651,724,891円

区分	2023年 1月20日現在
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	37,995,017円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	16,235,877円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	441,764,429円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	245,511,658円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	324,016,487円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	33,926,824円
ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	554,138,742円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	3,322,989,958円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,994,638,673円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,723,583,109円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,756,334,500円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,561,018,872円
分散投資コア戦略ファンドＳ	6,384,583,887円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	537,298,610円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	451,231,786円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,270,142,343円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	223,665,330円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,958,677円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	56,461,378円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	28,175,884,896円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	452,804,007円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	55,787,053円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	212,785,937円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	38,496,939円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	10,384,586円
グローバル経済コア	223,069,619円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	30,854,912円
Ｍｙ　ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	506,006,422円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	26,229,547円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	249,450,124円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	21,774,857円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	19,170,274円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	7,834,148円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	10,711,315円
１０資産分散投資ファンド	61,550円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	44,665,711,246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）	772,517,574円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	352,560,500円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	25,915,833円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	564,059,010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）	44,975,169,543円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	20,082,107円

区分	2023年 1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）	214,366,969円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,394,878,163
合計	1,394,878,163

(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

（2023年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,523,656,400	－	2,560,915,000	37,258,600
合計		2,523,656,400	－	2,560,915,000	37,258,600

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,600	3,760.00	36,096,000	
ニッスイ	252,900	526.00	133,025,400	
マルハニチロ	37,600	2,424.00	91,142,400	
雪国まいたけ	21,500	1,005.00	21,607,500	
カネコ種苗	8,300	1,473.00	12,225,900	
サカタのタネ	32,000	4,005.00	128,160,000	

ホクト	22,500	1,877.00	42,232,500	
ホクリヨウ	3,600	793.00	2,854,800	
住石ホールディングス	39,300	432.00	16,977,600	
日鉄鉱業	10,100	3,520.00	35,552,000	
三井松島ホールディングス	11,500	3,345.00	38,467,500	
ＩＮＰＥＸ	935,300	1,441.00	1,347,767,300	
石油資源開発	29,300	4,130.00	121,009,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	11,500	1,972.00	22,678,000	
ショーボンドホールディングス	34,400	5,290.00	181,976,000	
ミライト・ワン	87,700	1,539.00	134,970,300	
タマホーム	17,900	2,979.00	53,324,100	
サンヨーホームズ	3,100	707.00	2,191,700	
日本アクア	10,600	812.00	8,607,200	
ファーストコーポレーション	6,500	704.00	4,576,000	
ベステラ	5,500	942.00	5,181,000	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	43,000	164.00	7,052,000	
キャンディル	3,900	498.00	1,942,200	
ダイセキ環境ソリューション	5,100	966.00	4,926,600	
第一カッター興業	6,500	1,015.00	6,597,500	
安藤・間	146,500	852.00	124,818,000	
東急建設	72,000	647.00	46,584,000	
コムシスホールディングス	85,600	2,371.00	202,957,600	
ビーアールホールディングス	40,200	329.00	13,225,800	
高松コンストラクショングループ	16,400	1,937.00	31,766,800	
東建コーポレーション	8,200	7,710.00	63,222,000	
ソネック	2,700	942.00	2,543,400	
ヤマウラ	12,800	1,030.00	13,184,000	
オリエンタル白石	90,900	305.00	27,724,500	
大成建設	176,100	4,290.00	755,469,000	
大林組	632,700	966.00	611,188,200	
清水建設	531,900	697.00	370,734,300	
飛島建設	19,500	1,020.00	19,890,000	
長谷工コーポレーション	182,600	1,453.00	265,317,800	
松井建設	16,500	555.00	9,157,500	
錢高組	2,200	2,623.00	5,770,600	
鹿島建設	392,300	1,526.00	598,649,800	
不動テトラ	12,200	1,507.00	18,385,400	
大末建設	6,400	1,154.00	7,385,600	
鉄建建設	12,700	1,774.00	22,529,800	
西松建設	30,000	3,955.00	118,650,000	
三井住友建設	142,600	416.00	59,321,600	
大豊建設	7,300	3,440.00	25,112,000	

佐田建設	11,300	448.00	5,062,400	
ナカノフドー建設	12,600	322.00	4,057,200	
奥村組	28,700	2,968.00	85,181,600	
東鉄工業	24,400	2,628.00	64,123,200	
イチケン	4,000	1,790.00	7,160,000	
富士ピー・エス	7,900	437.00	3,452,300	
淺沼組	14,200	3,210.00	45,582,000	
戸田建設	217,600	689.00	149,926,400	
熊谷組	30,600	2,604.00	79,682,400	
北野建設	3,300	2,521.00	8,319,300	
植木組	5,000	1,295.00	6,475,000	
矢作建設工業	24,100	776.00	18,701,600	
ピーエス三菱	22,400	618.00	13,843,200	
日本ハウスホールディングス	35,100	378.00	13,267,800	
新日本建設	24,800	767.00	19,021,600	
東亜道路工業	3,500	5,980.00	20,930,000	
日本道路	3,600	5,830.00	20,988,000	
東亜建設工業	15,200	2,409.00	36,616,800	
日本国土開発	53,000	537.00	28,461,000	
若築建設	7,900	2,842.00	22,451,800	
東洋建設	57,300	874.00	50,080,200	
五洋建設	250,800	640.00	160,512,000	
世紀東急工業	23,300	788.00	18,360,400	
福田組	6,700	4,455.00	29,848,500	
住友林業	135,700	2,348.00	318,623,600	
日本基礎技術	10,700	510.00	5,457,000	
巴コーポレーション	19,800	399.00	7,900,200	
大和ハウス工業	494,400	3,077.00	1,521,268,800	
ライト工業	33,700	1,867.00	62,917,900	
積水ハウス	554,200	2,437.00	1,350,585,400	
日特建設	16,900	921.00	15,564,900	
北陸電気工事	12,100	677.00	8,191,700	
ユアテック	39,000	729.00	28,431,000	
日本リーテック	11,700	884.00	10,342,800	
四電工	7,400	1,757.00	13,001,800	
中電工	27,500	2,084.00	57,310,000	
関電工	96,900	845.00	81,880,500	
きんでん	124,500	1,407.00	175,171,500	
東京エネシス	17,600	921.00	16,209,600	
トーエネック	5,900	3,450.00	20,355,000	
住友電設	16,800	2,330.00	39,144,000	
日本電設工業	29,100	1,582.00	46,036,200	

エクシオグループ	81,500	2,270.00	185,005,000	
新日本空調	9,800	1,882.00	18,443,600	
九電工	43,000	3,340.00	143,620,000	
三機工業	39,200	1,520.00	59,584,000	
日揮ホールディングス	175,000	1,653.00	289,275,000	
中外炉工業	5,800	1,651.00	9,575,800	
ヤマト	14,700	675.00	9,922,500	
太平電業	11,000	3,180.00	34,980,000	
高砂熱学工業	42,600	1,779.00	75,785,400	
三晃金属工業	2,200	3,460.00	7,612,000	
朝日工業社	7,300	1,949.00	14,227,700	
明星工業	30,400	812.00	24,684,800	
大氣社	21,300	3,405.00	72,526,500	
ダイダン	11,600	2,161.00	25,067,600	
日比谷総合設備	15,200	1,909.00	29,016,800	
フィル・カンパニー	3,100	976.00	3,025,600	
テスホールディングス	19,000	1,128.00	21,432,000	
インフロニア・ホールディングス	185,400	1,012.00	187,624,800	
東洋エンジニアリング	23,400	587.00	13,735,800	
レイズネクスト	25,600	1,285.00	32,896,000	
ニップン	47,900	1,596.00	76,448,400	
日清製粉グループ本社	164,200	1,615.00	265,183,000	
日東富士製粉	3,200	4,280.00	13,696,000	
昭和産業	15,500	2,452.00	38,006,000	
鳥越製粉	14,200	577.00	8,193,400	
中部飼料	24,600	1,032.00	25,387,200	
フィード・ワン	26,000	704.00	18,304,000	
東洋精糖	3,300	868.00	2,864,400	
日本甜菜製糖	10,300	1,632.00	16,809,600	
DM三井製糖ホールディングス	17,600	1,994.00	35,094,400	
塩水港精糖	21,200	193.00	4,091,600	
ウェルネオシュガー	9,200	1,759.00	16,182,800	
森永製菓	32,900	3,735.00	122,881,500	
中村屋	4,400	3,065.00	13,486,000	
江崎グリコ	50,800	3,560.00	180,848,000	
名糖産業	7,000	1,659.00	11,613,000	
井村屋グループ	9,700	2,221.00	21,543,700	
不二家	12,200	2,478.00	30,231,600	
山崎製パン	118,900	1,508.00	179,301,200	
第一屋製パン	3,400	376.00	1,278,400	
モロゾフ	5,700	3,330.00	18,981,000	
亀田製菓	11,300	4,390.00	49,607,000	

寿スピリッツ	18,900	8,410.00	158,949,000	
カルビー	81,300	2,917.00	237,152,100	
森永乳業	32,300	4,805.00	155,201,500	
六甲バター	13,000	1,286.00	16,718,000	
ヤクルト本社	126,900	9,080.00	1,152,252,000	
明治ホールディングス	110,100	6,630.00	729,963,000	
雪印メグミルク	43,000	1,742.00	74,906,000	
プリマハム	23,900	2,122.00	50,715,800	
日本ハム	69,400	3,665.00	254,351,000	
林兼産業	5,400	469.00	2,532,600	
丸大食品	17,900	1,432.00	25,632,800	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	19,600	2,798.00	54,840,800	
柿安本店	6,900	2,010.00	13,869,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	138,000	696.00	96,048,000	
サッポロホールディングス	58,500	2,976.00	174,096,000	
アサヒグループホールディングス	410,400	4,148.00	1,702,339,200	
キリンホールディングス	801,500	1,959.00	1,570,138,500	
宝ホールディングス	121,200	1,029.00	124,714,800	
オエノンホールディングス	53,100	248.00	13,168,800	
養命酒製造	5,800	1,808.00	10,486,400	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	139,100	1,340.00	186,394,000	
サントリー食品インターナショナル	125,100	4,315.00	539,806,500	
ダイドーグループホールディングス	10,100	4,665.00	47,116,500	
伊藤園	66,200	4,225.00	279,695,000	
キーコーヒー	19,900	2,074.00	41,272,600	
ユニカフェ	5,900	894.00	5,274,600	
ジャパンフーズ	2,800	1,067.00	2,987,600	
日清オイリオグループ	25,000	3,100.00	77,500,000	
不二製油グループ本社	41,300	1,969.00	81,319,700	
かどや製油	2,100	3,470.00	7,287,000	
Ｊ－オイルミルズ	18,100	1,531.00	27,711,100	
キッコーマン	117,700	6,690.00	787,413,000	
味の素	434,700	4,094.00	1,779,661,800	
ブルドックソース	7,100	1,812.00	12,865,200	
キユーピー	95,400	2,172.00	207,208,800	
ハウス食品グループ本社	54,400	2,708.00	147,315,200	
カゴメ	82,700	3,025.00	250,167,500	
焼津水産化学工業	7,900	794.00	6,272,600	
アリアケジャパン	15,500	4,170.00	64,635,000	
ピエトロ	2,600	1,823.00	4,739,800	
エバラ食品工業	4,800	3,010.00	14,448,000	
やまみ	1,700	1,387.00	2,357,900	

ニチレイ	81,400	2,682.00	218,314,800	
東洋水産	89,800	4,975.00	446,755,000	
イートアンドホールディングス	7,500	2,319.00	17,392,500	
大冷	2,200	1,900.00	4,180,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,200	785.00	8,792,000	
日清食品ホールディングス	62,400	9,970.00	622,128,000	
永谷園ホールディングス	8,700	2,016.00	17,539,200	
一正蒲鉾	7,600	704.00	5,350,400	
フジッコ	18,200	1,895.00	34,489,000	
ロック・フィールド	21,700	1,534.00	33,287,800	
日本たばこ産業	1,169,200	2,630.00	3,074,996,000	
ケンコーマヨネーズ	12,200	1,331.00	16,238,200	
わらべや日洋ホールディングス	13,100	1,898.00	24,863,800	
なとり	11,200	2,051.00	22,971,200	
イフジ産業	3,000	901.00	2,703,000	
ファーマフーズ	27,500	1,319.00	36,272,500	
ユーグレナ	114,400	998.00	114,171,200	
紀文食品	13,900	941.00	13,079,900	
ピックルスホールディングス	10,400	1,234.00	12,833,600	
ミヨシ油脂	6,300	913.00	5,751,900	
理研ビタミン	15,300	1,825.00	27,922,500	
片倉工業	17,000	1,723.00	29,291,000	
グンゼ	13,700	4,075.00	55,827,500	
東洋紡	78,800	993.00	78,248,400	
ユニチカ	57,500	239.00	13,742,500	
富士紡ホールディングス	7,300	3,215.00	23,469,500	
倉敷紡績	13,800	2,122.00	29,283,600	
シキボウ	10,000	954.00	9,540,000	
日本毛織	48,400	938.00	45,399,200	
トーア紡コーポレーション	7,100	343.00	2,435,300	
帝国繊維	20,800	1,505.00	31,304,000	
帝人	174,100	1,294.00	225,285,400	
東レ	1,211,500	751.50	910,442,250	
住江織物	3,300	1,839.00	6,068,700	
日本フエルト	11,700	399.00	4,668,300	
イチカワ	2,800	1,306.00	3,656,800	
日東製網	2,100	1,467.00	3,080,700	
アツギ	11,100	397.00	4,406,700	
ダイニック	4,600	623.00	2,865,800	
セーレン	35,200	2,314.00	81,452,800	
ソトー	6,000	749.00	4,494,000	
東海染工	1,900	1,106.00	2,101,400	

小松マテーレ	26,500	750.00	19,875,000	
ワコールホールディングス	34,900	2,370.00	82,713,000	
ホギメディカル	24,300	3,445.00	83,713,500	
ＴＳＩホールディングス	65,100	474.00	30,857,400	
マツオカコーポレーション	5,100	1,077.00	5,492,700	
ワールド	23,400	1,290.00	30,186,000	
三陽商会	6,900	1,310.00	9,039,000	
ナイガイ	6,800	258.00	1,754,400	
オンワードホールディングス	117,900	317.00	37,374,300	
ルックホールディングス	5,300	2,470.00	13,091,000	
ゴールドウイン	32,000	9,420.00	301,440,000	
デサント	31,200	3,110.00	97,032,000	
キング	8,300	488.00	4,050,400	
ヤマトインターナショナル	15,100	242.00	3,654,200	
特種東海製紙	8,100	2,809.00	22,752,900	
王子ホールディングス	752,700	522.00	392,909,400	
日本製紙	94,100	924.00	86,948,400	
三菱製紙	21,700	274.00	5,945,800	
北越コーポレーション	114,200	822.00	93,872,400	
中越パルプ工業	7,300	971.00	7,088,300	
巴川製紙所	5,700	681.00	3,881,700	
大王製紙	79,800	964.00	76,927,200	
阿波製紙	4,300	610.00	2,623,000	
レンゴー	164,600	889.00	146,329,400	
トーモク	10,400	1,671.00	17,378,400	
ザ・パック	13,400	2,475.00	33,165,000	
北の達人コーポレーション	76,100	315.00	23,971,500	
クラレ	287,200	1,036.00	297,539,200	
旭化成	1,128,300	943.80	1,064,889,540	
共和レザー	10,400	499.00	5,189,600	
レゾナック・ホールディングス	174,600	2,096.00	365,961,600	
住友化学	1,340,300	479.00	642,003,700	
住友精化	7,500	4,010.00	30,075,000	
日産化学	85,800	5,830.00	500,214,000	
ラサ工業	7,000	1,899.00	13,293,000	
クレハ	15,400	8,230.00	126,742,000	
多木化学	7,000	4,505.00	31,535,000	
テイカ	12,100	1,186.00	14,350,600	
石原産業	32,700	1,071.00	35,021,700	
片倉コープアグリ	3,700	1,606.00	5,942,200	
日本曹達	19,400	4,000.00	77,600,000	
東ソー	241,200	1,561.00	376,513,200	

トクヤマ	58,400	1,789.00	104,477,600	
セントラル硝子	29,000	2,728.00	79,112,000	
東亞合成	92,900	1,140.00	105,906,000	
大阪ソーダ	10,800	4,060.00	43,848,000	
関東電化工業	34,900	925.00	32,282,500	
デンカ	65,700	2,641.00	173,513,700	
信越化学工業	304,900	16,800.00	5,122,320,000	
日本カーバイド工業	6,900	1,296.00	8,942,400	
堺化学工業	13,800	1,795.00	24,771,000	
第一稀元素化学工業	16,500	1,047.00	17,275,500	
エア・ウォーター	170,500	1,521.00	259,330,500	
日本酸素ホールディングス	175,300	2,025.00	354,982,500	
日本化学工業	6,000	1,807.00	10,842,000	
東邦アセチレン	3,800	1,123.00	4,267,400	
日本パーカライジング	89,400	930.00	83,142,000	
高圧ガス工業	26,200	648.00	16,977,600	
チタン工業	2,200	1,456.00	3,203,200	
四国化成ホールディングス	21,400	1,325.00	28,355,000	
戸田工業	4,100	2,484.00	10,184,400	
ステラ　ケミファ	10,700	2,530.00	27,071,000	
保土谷化学工業	5,100	3,130.00	15,963,000	
日本触媒	27,500	5,250.00	144,375,000	
大日精化工業	12,600	1,723.00	21,709,800	
カネカ	41,300	3,265.00	134,844,500	
三菱瓦斯化学	134,900	1,809.00	244,034,100	
三井化学	151,900	2,943.00	447,041,700	
ＪＳＲ	168,700	2,850.00	480,795,000	
東京応化工業	31,600	6,230.00	196,868,000	
大阪有機化学工業	13,600	1,968.00	26,764,800	
三菱ケミカルグループ	1,219,200	705.20	859,779,840	
ＫＨネオケム	30,100	2,745.00	82,624,500	
ダイセル	265,600	930.00	247,008,000	
住友ベークライト	26,800	4,030.00	108,004,000	
積水化学工業	369,500	1,876.00	693,182,000	
日本ゼオン	108,400	1,299.00	140,811,600	
アイカ工業	45,600	3,020.00	137,712,000	
ＵＢＥ	93,100	1,956.00	182,103,600	
積水樹脂	26,300	1,870.00	49,181,000	
タキロンシーアイ	39,500	508.00	20,066,000	
旭有機材	12,000	2,771.00	33,252,000	
ニチバン	11,200	1,818.00	20,361,600	
リケンテクノス	38,900	499.00	19,411,100	

大倉工業	8,400	1,876.00	15,758,400	
積水化成品工業	25,400	379.00	9,626,600	
群栄化学工業	4,200	2,400.00	10,080,000	
タイガースポリマー	8,200	396.00	3,247,200	
ミライアル	5,500	1,503.00	8,266,500	
ダイキアクシス	6,600	682.00	4,501,200	
ダイキョーニシカワ	39,900	569.00	22,703,100	
竹本容器	6,100	747.00	4,556,700	
森六ホールディングス	9,200	1,746.00	16,063,200	
恵和	11,700	1,546.00	18,088,200	
日本化薬	138,000	1,147.00	158,286,000	
カーリットホールディングス	16,200	749.00	12,133,800	
日本精化	10,300	2,354.00	24,246,200	
扶桑化学工業	16,800	3,435.00	57,708,000	
トリケミカル研究所	24,100	2,238.00	53,935,800	
ＡＤＥＫＡ	63,000	2,101.00	132,363,000	
日油	55,900	5,360.00	299,624,000	
新日本理化	24,900	228.00	5,677,200	
ハリマ化成グループ	12,700	815.00	10,350,500	
花王	440,000	5,193.00	2,284,920,000	
第一工業製薬	6,500	1,935.00	12,577,500	
石原ケミカル	8,300	1,239.00	10,283,700	
日華化学	7,300	778.00	5,679,400	
ニイタカ	3,600	1,946.00	7,005,600	
三洋化成工業	11,100	4,110.00	45,621,000	
有機合成薬品工業	13,300	290.00	3,857,000	
大日本塗料	22,000	775.00	17,050,000	
日本ペイントホールディングス	799,500	1,116.00	892,242,000	
関西ペイント	165,500	1,635.00	270,592,500	
神東塗料	15,100	127.00	1,917,700	
中国塗料	32,400	968.00	31,363,200	
日本特殊塗料	11,500	848.00	9,752,000	
藤倉化成	24,300	426.00	10,351,800	
太陽ホールディングス	27,500	2,265.00	62,287,500	
ＤＩＣ	70,600	2,346.00	165,627,600	
サカタインクス	40,200	1,025.00	41,205,000	
東洋インキＳＣホールディングス	35,400	1,791.00	63,401,400	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	16,100	1,275.00	20,527,500	
富士フイルムホールディングス	347,100	6,709.00	2,328,693,900	
資生堂	377,700	6,426.00	2,427,100,200	
ライオン	217,100	1,396.00	303,071,600	
高砂香料工業	12,200	2,499.00	30,487,800	

マンダム	39,100	1,385.00	54,153,500	
ミルボン	26,800	5,400.00	144,720,000	
ファンケル	79,100	2,590.00	204,869,000	
コーセー	36,800	13,570.00	499,376,000	
コタ	15,100	1,680.00	25,368,000	
シーボン	2,300	1,561.00	3,590,300	
ポーラ・オルビスホールディングス	92,700	1,768.00	163,893,600	
ノエビアホールディングス	16,100	5,550.00	89,355,000	
アジュバンホールディングス	4,400	955.00	4,202,000	
新日本製薬	10,300	1,380.00	14,214,000	
エステー	14,000	1,545.00	21,630,000	
アグロ　カネショウ	7,200	1,536.00	11,059,200	
コニシ	30,200	1,770.00	53,454,000	
長谷川香料	37,500	2,983.00	111,862,500	
星光ＰＭＣ	9,200	530.00	4,876,000	
小林製薬	52,600	9,030.00	474,978,000	
荒川化学工業	15,300	991.00	15,162,300	
メック	14,900	2,408.00	35,879,200	
日本高純度化学	4,500	2,352.00	10,584,000	
タカラバイオ	48,700	1,690.00	82,303,000	
ＪＣＵ	20,400	3,105.00	63,342,000	
新田ゼラチン	11,200	834.00	9,340,800	
ＯＡＴアグリオ	7,400	1,460.00	10,804,000	
デクセリアルズ	52,200	2,698.00	140,835,600	
アース製薬	16,400	4,930.00	80,852,000	
北興化学工業	18,200	802.00	14,596,400	
大成ラミック	5,700	2,911.00	16,592,700	
クミアイ化学工業	71,900	840.00	60,396,000	
日本農薬	33,200	680.00	22,576,000	
アキレス	11,800	1,230.00	14,514,000	
有沢製作所	29,600	1,352.00	40,019,200	
日東電工	131,300	7,840.00	1,029,392,000	
レック	25,700	970.00	24,929,000	
三光合成	24,800	480.00	11,904,000	
きもと	26,600	224.00	5,958,400	
藤森工業	14,300	3,220.00	46,046,000	
前澤化成工業	11,700	1,354.00	15,841,800	
未来工業	6,500	1,462.00	9,503,000	
ウェーブロックホールディングス	5,400	611.00	3,299,400	
ＪＳＰ	12,700	1,513.00	19,215,100	
エフピコ	34,200	3,420.00	116,964,000	
天馬	15,400	2,085.00	32,109,000	

信越ポリマー	33,400	1,176.00	39,278,400	
東リ	40,600	223.00	9,053,800	
ニフコ	65,300	3,260.00	212,878,000	
バルカー	15,100	2,678.00	40,437,800	
ユニ・チャーム	376,900	4,788.00	1,804,597,200	
ショーエイコーポレーション	5,200	580.00	3,016,000	
協和キリン	218,600	2,856.00	624,321,600	
武田薬品工業	1,601,000	4,172.00	6,679,372,000	
アステラス製薬	1,733,700	1,958.50	3,395,451,450	
住友ファーマ	134,300	884.00	118,721,200	
塩野義製薬	231,200	6,108.00	1,412,169,600	
わかもと製薬	17,400	217.00	3,775,800	
日本新薬	42,700	6,690.00	285,663,000	
中外製薬	566,300	3,352.00	1,898,237,600	
科研製薬	31,000	3,775.00	117,025,000	
エーザイ	220,100	8,394.00	1,847,519,400	
ロート製薬	175,300	2,251.00	394,600,300	
小野薬品工業	349,100	2,894.50	1,010,469,950	
久光製薬	40,200	3,860.00	155,172,000	
持田製薬	21,700	3,315.00	71,935,500	
参天製薬	340,500	1,026.00	349,353,000	
扶桑薬品工業	5,800	1,927.00	11,176,600	
日本ケミファ	1,900	1,715.00	3,258,500	
ツムラ	57,000	2,702.00	154,014,000	
キッセイ薬品工業	28,000	2,534.00	70,952,000	
生化学工業	34,600	826.00	28,579,600	
栄研化学	29,400	1,599.00	47,010,600	
鳥居薬品	9,800	2,977.00	29,174,600	
ＪＣＲファーマ	61,300	1,550.00	95,015,000	
東和薬品	27,900	2,038.00	56,860,200	
富士製薬工業	11,800	1,029.00	12,142,200	
ゼリア新薬工業	25,100	2,141.00	53,739,100	
第一三共	1,576,000	4,208.00	6,631,808,000	
キョーリン製薬ホールディングス	39,300	1,689.00	66,377,700	
大幸薬品	33,100	372.00	12,313,200	
ダイト	13,700	2,582.00	35,373,400	
大塚ホールディングス	413,900	4,158.00	1,720,996,200	
大正製薬ホールディングス	40,200	5,440.00	218,688,000	
ペプチドリーム	87,800	2,025.00	177,795,000	
あすか製薬ホールディングス	18,600	1,241.00	23,082,600	
サワイグループホールディングス	41,400	3,915.00	162,081,000	
日本コークス工業	163,200	91.00	14,851,200	

ニチレキ	21,400	1,316.00	28,162,400	
ユシロ化学工業	9,400	778.00	7,313,200	
ビーピー・カストロール	7,000	867.00	6,069,000	
富士石油	36,900	260.00	9,594,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,900	1,153.00	6,802,700	
出光興産	200,900	3,215.00	645,893,500	
ＥＮＥＯＳホールディングス	3,268,400	468.10	1,529,938,040	
コスモエネルギーホールディングス	71,500	3,680.00	263,120,000	
横浜ゴム	102,900	2,065.00	212,488,500	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	104,000	1,483.00	154,232,000	
ブリヂストン	577,700	4,749.00	2,743,497,300	
住友ゴム工業	177,400	1,126.00	199,752,400	
藤倉コンポジット	12,800	858.00	10,982,400	
オカモト	10,000	3,750.00	37,500,000	
フコク	9,500	1,028.00	9,766,000	
ニッタ	18,400	2,838.00	52,219,200	
住友理工	35,100	655.00	22,990,500	
三ツ星ベルト	26,400	3,610.00	95,304,000	
バンドー化学	28,700	971.00	27,867,700	
日東紡績	21,600	1,971.00	42,573,600	
ＡＧＣ	184,100	4,615.00	849,621,500	
日本板硝子	92,200	597.00	55,043,400	
石塚硝子	2,900	1,405.00	4,074,500	
日本山村硝子	6,900	516.00	3,560,400	
日本電気硝子	73,900	2,379.00	175,808,100	
オハラ	8,700	1,144.00	9,952,800	
住友大阪セメント	25,500	3,230.00	82,365,000	
太平洋セメント	115,200	2,110.00	243,072,000	
日本ヒューム	16,000	653.00	10,448,000	
日本コンクリート工業	35,500	222.00	7,881,000	
三谷セキサン	7,600	3,815.00	28,994,000	
アジアパイルホールディングス	28,400	599.00	17,011,600	
東海カーボン	151,800	1,069.00	162,274,200	
日本カーボン	10,400	4,300.00	44,720,000	
東洋炭素	11,400	3,795.00	43,263,000	
ノリタケカンパニーリミテド	9,000	3,995.00	35,955,000	
ＴＯＴＯ	119,400	4,895.00	584,463,000	
日本碍子	214,100	1,701.00	364,184,100	
日本特殊陶業	137,800	2,465.00	339,677,000	
ＭＡＲＵＷＡ	6,700	16,920.00	113,364,000	
品川リフラクトリーズ	5,100	4,190.00	21,369,000	
黒崎播磨	3,700	5,780.00	21,386,000	

ヨータイ	12,100	1,505.00	18,210,500	
東京窯業	16,900	271.00	4,579,900	
ニッカトー	8,300	517.00	4,291,100	
フジミインコーポレーテッド	14,400	6,500.00	93,600,000	
クニミネ工業	5,400	832.00	4,492,800	
エーアンドエーマテリアル	3,400	882.00	2,998,800	
ニチアス	45,800	2,373.00	108,683,400	
ニチハ	22,700	2,675.00	60,722,500	
日本製鉄	833,400	2,628.00	2,190,175,200	
神戸製鋼所	374,400	667.00	249,724,800	
中山製鋼所	38,400	918.00	35,251,200	
合同製鐵	9,300	2,477.00	23,036,100	
ＪＦＥホールディングス	497,400	1,642.00	816,730,800	
東京製鐵	52,300	1,252.00	65,479,600	
共英製鋼	21,200	1,347.00	28,556,400	
大和工業	30,700	5,020.00	154,114,000	
東京鐵鋼	8,900	1,630.00	14,507,000	
大阪製鐵	8,600	1,253.00	10,775,800	
淀川製鋼所	21,200	2,634.00	55,840,800	
丸一鋼管	56,700	2,758.00	156,378,600	
モリ工業	4,300	2,956.00	12,710,800	
大同特殊鋼	23,500	4,535.00	106,572,500	
日本高周波鋼業	6,400	310.00	1,984,000	
日本冶金工業	13,600	4,530.00	61,608,000	
山陽特殊製鋼	18,400	2,267.00	41,712,800	
愛知製鋼	10,800	2,217.00	23,943,600	
日本金属	4,100	905.00	3,710,500	
大平洋金属	13,200	1,993.00	26,307,600	
新日本電工	119,100	383.00	45,615,300	
栗本鐵工所	8,900	1,753.00	15,601,700	
虹技	2,300	912.00	2,097,600	
三菱製鋼	11,700	1,113.00	13,022,100	
日亜鋼業	19,100	247.00	4,717,700	
日本精線	2,500	4,390.00	10,975,000	
エンビプロ・ホールディングス	12,900	718.00	9,262,200	
シンニッタン	20,300	234.00	4,750,200	
新家工業	4,100	2,341.00	9,598,100	
大紀アルミニウム工業所	26,600	1,407.00	37,426,200	
日本軽金属ホールディングス	50,300	1,583.00	79,624,900	
三井金属鉱業	54,200	3,315.00	179,673,000	
東邦亜鉛	11,100	2,171.00	24,098,100	
三菱マテリアル	124,200	2,197.00	272,867,400	

住友金属鉱山	215,800	5,219.00	1,126,260,200	
ＤＯＷＡホールディングス	41,800	4,395.00	183,711,000	
古河機械金属	27,400	1,285.00	35,209,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,300	3,750.00	102,375,000	
東邦チタニウム	33,700	2,680.00	90,316,000	
ＵＡＣＪ	26,100	2,464.00	64,310,400	
ＣＫサンエツ	4,500	4,110.00	18,495,000	
古河電気工業	62,000	2,384.00	147,808,000	
住友電気工業	642,700	1,490.50	957,944,350	
フジクラ	199,700	945.00	188,716,500	
昭和電線ホールディングス	20,900	1,756.00	36,700,400	
タツタ電線	38,000	713.00	27,094,000	
カナレ電気	3,000	1,383.00	4,149,000	
平河ヒューテック	10,800	1,121.00	12,106,800	
リョービ	19,900	1,174.00	23,362,600	
アーレスティ	20,900	426.00	8,903,400	
アサヒホールディングス	75,300	1,998.00	150,449,400	
稲葉製作所	10,900	1,384.00	15,085,600	
宮地エンジニアリンググループ	5,100	3,545.00	18,079,500	
トーカロ	51,200	1,179.00	60,364,800	
アルファＣｏ	6,800	908.00	6,174,400	
ＳＵＭＣＯ	354,300	1,877.00	665,021,100	
川田テクノロジーズ	4,400	3,330.00	14,652,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	12,200	3,805.00	46,421,000	
ジェイテックコーポレーション	2,500	2,930.00	7,325,000	
信和	10,300	793.00	8,167,900	
東洋製罐グループホールディングス	123,200	1,629.00	200,692,800	
ホッカンホールディングス	10,000	1,372.00	13,720,000	
コロナ	10,400	888.00	9,235,200	
横河ブリッジホールディングス	24,600	1,868.00	45,952,800	
駒井ハルテック	3,000	1,550.00	4,650,000	
高田機工	1,500	2,477.00	3,715,500	
三和ホールディングス	171,400	1,235.00	211,679,000	
文化シヤッター	53,600	1,130.00	60,568,000	
三協立山	25,500	617.00	15,733,500	
アルインコ	14,200	1,006.00	14,285,200	
東洋シヤッター	4,300	494.00	2,124,200	
ＬＩＸＩＬ	271,100	2,068.00	560,634,800	
日本フイルコン	12,100	442.00	5,348,200	
ノーリツ	27,400	1,427.00	39,099,800	
長府製作所	18,700	1,979.00	37,007,300	
リンナイ	33,700	9,720.00	327,564,000	

ダイニチ工業	9,300	680.00	6,324,000	
日東精工	27,000	497.00	13,419,000	
三洋工業	2,100	1,839.00	3,861,900	
岡部	29,900	713.00	21,318,700	
ジーテクト	20,700	1,437.00	29,745,900	
東プレ	32,800	1,175.00	38,540,000	
高周波熱錬	30,400	667.00	20,276,800	
東京製綱	11,000	993.00	10,923,000	
サンコール	16,500	645.00	10,642,500	
モリテック　スチール	13,700	274.00	3,753,800	
パイオラックス	25,700	1,725.00	44,332,500	
エイチワン	19,200	630.00	12,096,000	
日本発條	164,600	857.00	141,062,200	
中央発條	10,300	722.00	7,436,600	
アドバネクス	2,300	1,059.00	2,435,700	
立川ブラインド工業	8,400	1,191.00	10,004,400	
三益半導体工業	16,800	2,439.00	40,975,200	
日本ドライケミカル	4,400	1,409.00	6,199,600	
日本製鋼所	50,200	2,591.00	130,068,200	
三浦工業	76,100	3,140.00	238,954,000	
タクマ	56,100	1,230.00	69,003,000	
ツガミ	40,600	1,259.00	51,115,400	
オークマ	18,300	4,805.00	87,931,500	
芝浦機械	18,300	2,761.00	50,526,300	
アマダ	290,800	1,105.00	321,334,000	
アイダエンジニアリング	37,700	778.00	29,330,600	
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	4,900	1,090.00	5,341,000	
ＦＵＪＩ	79,200	2,050.00	162,360,000	
牧野フライス製作所	20,200	4,360.00	88,072,000	
オーエスジー	87,100	1,915.00	166,796,500	
ダイジェット工業	2,000	835.00	1,670,000	
旭ダイヤモンド工業	51,100	711.00	36,332,100	
ＤＭＧ森精機	110,500	1,847.00	204,093,500	
ソディック	50,400	730.00	36,792,000	
ディスコ	29,200	39,100.00	1,141,720,000	
日東工器	8,900	1,510.00	13,439,000	
日進工具	15,300	992.00	15,177,600	
パンチ工業	16,000	443.00	7,088,000	
冨士ダイス	8,700	568.00	4,941,600	
豊和工業	10,100	920.00	9,292,000	
ニデックオーケーケー	7,300	962.00	7,022,600	
東洋機械金属	12,800	551.00	7,052,800	

津田駒工業	3,300	545.00	1,798,500	
エンシュウ	4,100	665.00	2,726,500	
島精機製作所	29,100	1,879.00	54,678,900	
オプトラン	27,000	2,491.00	67,257,000	
ＮＣホールディングス	3,700	1,957.00	7,240,900	
イワキポンプ	12,200	1,249.00	15,237,800	
フリュー	19,200	1,070.00	20,544,000	
ヤマシンフィルタ	43,600	533.00	23,238,800	
日阪製作所	17,800	828.00	14,738,400	
やまびこ	29,800	1,084.00	32,303,200	
野村マイクロ・サイエンス	6,200	4,285.00	26,567,000	
平田機工	8,700	5,970.00	51,939,000	
ペガサスミシン製造	20,200	780.00	15,756,000	
マルマエ	8,900	1,670.00	14,863,000	
タツモ	10,000	1,806.00	18,060,000	
ナブテスコ	114,400	3,505.00	400,972,000	
三井海洋開発	22,900	1,386.00	31,739,400	
レオン自動機	19,200	1,029.00	19,756,800	
ＳＭＣ	59,100	61,300.00	3,622,830,000	
ホソカワミクロン	14,000	2,661.00	37,254,000	
ユニオンツール	8,000	3,270.00	26,160,000	
オイレス工業	25,500	1,472.00	37,536,000	
日精エー・エス・ビー機械	8,300	4,660.00	38,678,000	
サトーホールディングス	26,000	1,961.00	50,986,000	
技研製作所	19,100	2,787.00	53,231,700	
日本エアーテック	9,300	1,061.00	9,867,300	
カワタ	5,400	814.00	4,395,600	
日精樹脂工業	13,700	956.00	13,097,200	
オカダアイヨン	5,700	1,534.00	8,743,800	
ワイエイシイホールディングス	7,800	2,005.00	15,639,000	
小松製作所	853,700	2,977.50	2,541,891,750	
住友重機械工業	107,800	2,685.00	289,443,000	
日立建機	72,600	2,952.00	214,315,200	
日工	27,300	618.00	16,871,400	
巴工業	7,900	2,327.00	18,383,300	
井関農機	17,200	1,185.00	20,382,000	
ＴＯＷＡ	18,600	1,927.00	35,842,200	
丸山製作所	3,200	1,534.00	4,908,800	
北川鉄工所	7,300	1,164.00	8,497,200	
ローツェ	9,500	9,760.00	92,720,000	
タカキタ	5,300	434.00	2,300,200	
クボタ	964,100	1,874.50	1,807,205,450	

荏原実業	8,800	2,372.00	20,873,600	
三菱化工機	6,000	2,143.00	12,858,000	
月島機械	24,800	975.00	24,180,000	
帝国電機製作所	13,200	2,368.00	31,257,600	
新東工業	37,100	693.00	25,710,300	
澁谷工業	17,200	2,306.00	39,663,200	
アイチ　コーポレーション	26,000	767.00	19,942,000	
小森コーポレーション	42,400	842.00	35,700,800	
鶴見製作所	14,000	1,958.00	27,412,000	
日本ギア工業	6,400	344.00	2,201,600	
酒井重工業	3,000	3,480.00	10,440,000	
荏原製作所	74,600	4,930.00	367,778,000	
石井鐵工所	2,100	2,253.00	4,731,300	
酉島製作所	15,800	1,487.00	23,494,600	
北越工業	18,400	1,289.00	23,717,600	
ダイキン工業	217,500	21,770.00	4,734,975,000	
オルガノ	25,100	3,075.00	77,182,500	
トーヨーカネツ	7,000	2,643.00	18,501,000	
栗田工業	101,900	5,590.00	569,621,000	
椿本チエイン	25,900	3,010.00	77,959,000	
大同工業	7,500	732.00	5,490,000	
木村化工機	14,100	705.00	9,940,500	
アネスト岩田	31,100	851.00	26,466,100	
ダイフク	94,000	6,590.00	619,460,000	
サムコ	6,000	3,365.00	20,190,000	
加藤製作所	8,800	694.00	6,107,200	
油研工業	2,800	1,810.00	5,068,000	
タダノ	96,300	921.00	88,692,300	
フジテック	66,700	3,030.00	202,101,000	
ＣＫＤ	50,400	1,931.00	97,322,400	
平和	60,600	2,349.00	142,349,400	
理想科学工業	16,200	2,061.00	33,388,200	
ＳＡＮＫＹＯ	35,800	5,190.00	185,802,000	
日本金銭機械	20,100	1,196.00	24,039,600	
マースグループホールディングス	10,800	2,294.00	24,775,200	
フクシマガリレイ	13,400	4,220.00	56,548,000	
オーイズミ	7,000	508.00	3,556,000	
ダイコク電機	10,000	2,075.00	20,750,000	
竹内製作所	33,100	2,714.00	89,833,400	
アマノ	51,800	2,329.00	120,642,200	
ＪＵＫＩ	28,400	613.00	17,409,200	
ジャノメ	18,600	585.00	10,881,000	

マックス	22,500	1,919.00	43,177,500	
グローリー	47,300	2,189.00	103,539,700	
新晃工業	18,400	1,509.00	27,765,600	
大和冷機工業	28,000	1,158.00	32,424,000	
セガサミーホールディングス	146,500	1,992.00	291,828,000	
日本ピストンリング	6,200	1,226.00	7,601,200	
リケン	7,200	2,288.00	16,473,600	
ＴＰＲ	21,400	1,235.00	26,429,000	
ツバキ・ナカシマ	45,000	1,085.00	48,825,000	
ホシザキ	117,300	4,435.00	520,225,500	
大豊工業	15,900	622.00	9,889,800	
日本精工	334,800	702.00	235,029,600	
ＮＴＮ	359,200	260.00	93,392,000	
ジェイテクト	162,200	905.00	146,791,000	
不二越	13,500	3,605.00	48,667,500	
日本トムソン	44,800	566.00	25,356,800	
ＴＨＫ	105,100	2,616.00	274,941,600	
ユーシン精機	14,600	672.00	9,811,200	
前澤給装工業	12,900	916.00	11,816,400	
イーグル工業	20,200	1,077.00	21,755,400	
前澤工業	11,900	591.00	7,032,900	
日本ピラー工業	16,900	3,055.00	51,629,500	
キッツ	67,200	790.00	53,088,000	
マキタ	226,700	3,345.00	758,311,500	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	82,700	385.00	31,839,500	
日立造船	149,500	799.00	119,450,500	
三菱重工業	318,600	4,898.00	1,560,502,800	
ＩＨＩ	114,800	3,720.00	427,056,000	
スター精密	34,400	1,629.00	56,037,600	
日清紡ホールディングス	148,300	941.00	139,550,300	
イビデン	104,600	4,915.00	514,109,000	
コニカミノルタ	407,700	509.00	207,519,300	
ブラザー工業	243,600	1,945.00	473,802,000	
ミネベアミツミ	317,100	2,097.00	664,958,700	
日立製作所	914,700	6,643.00	6,076,352,100	
東芝	350,600	4,529.00	1,587,867,400	
三菱電機	1,882,900	1,317.00	2,479,779,300	
富士電機	110,800	5,050.00	559,540,000	
東洋電機製造	6,500	839.00	5,453,500	
安川電機	215,900	4,705.00	1,015,809,500	
シンフォニアテクノロジー	20,100	1,513.00	30,411,300	
明電舎	27,600	1,853.00	51,142,800	

オリジン	4,100	1,257.00	5,153,700	
山洋電気	7,900	5,920.00	46,768,000	
デンヨー	13,900	1,489.00	20,697,100	
ＰＨＣホールディングス	25,600	1,558.00	39,884,800	
ソシオネクスト	18,800	7,450.00	140,060,000	
東芝テック	27,200	3,570.00	97,104,000	
芝浦メカトロニクス	3,500	10,770.00	37,695,000	
マブチモーター	45,400	3,625.00	164,575,000	
日本電産	442,500	7,215.00	3,192,637,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	14,300	477.00	6,821,100	
トレックス・セミコンダクター	8,700	2,676.00	23,281,200	
東光高岳	11,200	2,140.00	23,968,000	
ダブル・スコープ	59,600	1,356.00	80,817,600	
ダイヘン	16,500	4,030.00	66,495,000	
ヤーマン	35,800	1,319.00	47,220,200	
ＪＶＣケンウッド	167,200	357.00	59,690,400	
ミマキエンジニアリング	18,000	601.00	10,818,000	
Ｉ－ＰＥＸ	10,500	1,146.00	12,033,000	
日新電機	43,600	1,286.00	56,069,600	
大崎電気工業	43,200	536.00	23,155,200	
オムロン	166,900	6,790.00	1,133,251,000	
日東工業	24,600	2,373.00	58,375,800	
ＩＤＥＣ	26,900	2,946.00	79,247,400	
正興電機製作所	7,300	924.00	6,745,200	
不二電機工業	4,000	1,132.00	4,528,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	60,000	2,154.00	129,240,000	
サクサホールディングス	3,800	1,189.00	4,518,200	
メルコホールディングス	5,000	3,115.00	15,575,000	
テクノメディカ	4,700	1,753.00	8,239,100	
日本電気	257,700	4,470.00	1,151,919,000	
富士通	181,500	18,310.00	3,323,265,000	
沖電気工業	82,400	710.00	58,504,000	
岩崎通信機	8,000	763.00	6,104,000	
電気興業	7,300	1,931.00	14,096,300	
サンケン電気	16,900	6,860.00	115,934,000	
ナカヨ	2,900	1,044.00	3,027,600	
アイホン	11,100	1,819.00	20,190,900	
ルネサスエレクトロニクス	1,189,000	1,292.00	1,536,188,000	
セイコーエプソン	242,600	1,897.00	460,212,200	
ワコム	145,000	612.00	88,740,000	
アルバック	43,300	5,800.00	251,140,000	
アクセル	7,100	1,720.00	12,212,000	

ＥＩＺＯ	13,300	3,525.00	46,882,500	
日本信号	41,500	1,040.00	43,160,000	
京三製作所	38,200	399.00	15,241,800	
能美防災	24,900	1,624.00	40,437,600	
ホーチキ	13,900	1,406.00	19,543,400	
星和電機	8,200	430.00	3,526,000	
エレコム	43,900	1,318.00	57,860,200	
パナソニック　ホールディングス	2,151,900	1,146.50	2,467,153,350	
シャープ	219,400	1,029.00	225,762,600	
アンリツ	128,300	1,240.00	159,092,000	
富士通ゼネラル	51,600	3,595.00	185,502,000	
ソニーグループ	1,276,000	11,430.00	14,584,680,000	
ＴＤＫ	288,600	4,430.00	1,278,498,000	
帝国通信工業	8,500	1,405.00	11,942,500	
タムラ製作所	78,200	728.00	56,929,600	
アルプスアルパイン	163,100	1,236.00	201,591,600	
池上通信機	5,700	566.00	3,226,200	
日本電波工業	22,100	1,477.00	32,641,700	
鈴木	11,200	975.00	10,920,000	
メイコー	20,000	2,763.00	55,260,000	
日本トリム	4,200	2,928.00	12,297,600	
ローランド　ディー．ジー．	10,400	2,830.00	29,432,000	
フォスター電機	16,900	938.00	15,852,200	
ＳＭＫ	4,400	2,389.00	10,511,600	
ヨコオ	14,700	2,147.00	31,560,900	
ホシデン	43,900	1,535.00	67,386,500	
ヒロセ電機	30,100	16,240.00	488,824,000	
日本航空電子工業	37,400	2,163.00	80,896,200	
ＴＯＡ	20,700	772.00	15,980,400	
マクセル	39,900	1,394.00	55,620,600	
古野電気	24,100	909.00	21,906,900	
スミダコーポレーション	17,000	1,343.00	22,831,000	
アイコム	7,000	2,530.00	17,710,000	
リオン	7,700	1,786.00	13,752,200	
横河電機	199,300	2,157.00	429,890,100	
新電元工業	7,000	3,230.00	22,610,000	
アズビル	126,000	3,505.00	441,630,000	
東亜ディーケーケー	9,000	757.00	6,813,000	
日本光電工業	83,500	3,285.00	274,297,500	
チノー	7,500	1,861.00	13,957,500	
共和電業	17,000	335.00	5,695,000	
日本電子材料	11,900	1,450.00	17,255,000	

堀場製作所	40,200	5,700.00	229,140,000	
アドバンテスト	142,100	9,440.00	1,341,424,000	
小野測器	7,800	384.00	2,995,200	
エスペック	14,700	1,888.00	27,753,600	
キーエンス	180,500	56,800.00	10,252,400,000	
日置電機	9,500	6,300.00	59,850,000	
シスメックス	155,600	8,432.00	1,312,019,200	
日本マイクロニクス	30,000	1,393.00	41,790,000	
メガチップス	15,000	2,574.00	38,610,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8,600	3,650.00	31,390,000	
澤藤電機	2,500	1,073.00	2,682,500	
原田工業	8,500	821.00	6,978,500	
コーセル	24,500	1,058.00	25,921,000	
イリソ電子工業	16,700	4,185.00	69,889,500	
オプテックスグループ	33,300	1,962.00	65,334,600	
千代田インテグレ	6,500	2,210.00	14,365,000	
レーザーテック	89,100	25,295.00	2,253,784,500	
スタンレー電気	128,500	2,574.00	330,759,000	
岩崎電気	6,000	2,291.00	13,746,000	
ウシオ電機	94,500	1,685.00	159,232,500	
岡谷電機産業	15,600	246.00	3,837,600	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	17,600	468.00	8,236,800	
エノモト	4,800	1,782.00	8,553,600	
日本セラミック	18,600	2,325.00	43,245,000	
遠藤照明	8,700	733.00	6,377,100	
古河電池	13,700	1,081.00	14,809,700	
双信電機	8,400	368.00	3,091,200	
山一電機	16,000	1,782.00	28,512,000	
図研	15,800	2,993.00	47,289,400	
日本電子	45,300	3,730.00	168,969,000	
カシオ計算機	134,400	1,319.00	177,273,600	
ファナック	177,100	21,560.00	3,818,276,000	
日本シイエムケイ	39,200	482.00	18,894,400	
エンプラス	5,400	3,595.00	19,413,000	
大真空	22,600	747.00	16,882,200	
ローム	83,400	9,970.00	831,498,000	
浜松ホトニクス	144,800	6,700.00	970,160,000	
三井ハイテック	18,700	6,760.00	126,412,000	
新光電気工業	63,900	3,650.00	233,235,000	
京セラ	280,300	6,506.00	1,823,631,800	
太陽誘電	87,900	4,385.00	385,441,500	
村田製作所	547,100	7,308.00	3,998,206,800	

双葉電子工業	35,100	544.00	19,094,400	
北陸電気工業	7,100	1,252.00	8,889,200	
ニチコン	37,200	1,224.00	45,532,800	
日本ケミコン	18,100	1,604.00	29,032,400	
ＫＯＡ	27,500	1,883.00	51,782,500	
市光工業	27,200	361.00	9,819,200	
小糸製作所	217,100	2,031.00	440,930,100	
ミツバ	33,800	464.00	15,683,200	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	30,800	9,250.00	284,900,000	
キヤノン電子	20,200	1,518.00	30,663,600	
キヤノン	989,600	2,858.00	2,828,276,800	
リコー	452,300	969.00	438,278,700	
象印マホービン	54,200	1,491.00	80,812,200	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,700	1,586.00	4,282,200	
東京エレクトロン	127,300	44,450.00	5,658,485,000	
イノテック	12,300	1,310.00	16,113,000	
トヨタ紡織	76,000	1,832.00	139,232,000	
芦森工業	3,300	1,298.00	4,283,400	
ユニプレス	32,400	757.00	24,526,800	
豊田自動織機	131,900	7,620.00	1,005,078,000	
モリタホールディングス	31,600	1,155.00	36,498,000	
三櫻工業	27,500	640.00	17,600,000	
デンソー	372,000	6,709.00	2,495,748,000	
東海理化電機製作所	50,900	1,425.00	72,532,500	
川崎重工業	135,900	2,836.00	385,412,400	
名村造船所	46,200	361.00	16,678,200	
日本車輌製造	6,900	1,963.00	13,544,700	
三菱ロジスネクスト	28,800	655.00	18,864,000	
近畿車輛	2,500	1,078.00	2,695,000	
日産自動車	2,562,300	430.40	1,102,813,920	
いすゞ自動車	524,400	1,506.00	789,746,400	
トヨタ自動車	9,904,500	1,883.00	18,650,173,500	
日野自動車	232,500	509.00	118,342,500	
三菱自動車工業	703,700	484.00	340,590,800	
エフテック	12,500	508.00	6,350,000	
レシップホールディングス	7,100	457.00	3,244,700	
ＧＭＢ	3,500	693.00	2,425,500	
ファルテック	2,800	595.00	1,666,000	
武蔵精密工業	44,100	1,649.00	72,720,900	
日産車体	31,800	836.00	26,584,800	
新明和工業	56,700	1,031.00	58,457,700	
極東開発工業	31,700	1,421.00	45,045,700	

トピー工業	14,600	1,604.00	23,418,400	
ティラド	4,500	2,633.00	11,848,500	
曙ブレーキ工業	110,100	146.00	16,074,600	
タチエス	28,500	1,147.00	32,689,500	
ＮＯＫ	70,100	1,175.00	82,367,500	
フタバ産業	48,300	358.00	17,291,400	
ＫＹＢ	17,400	3,535.00	61,509,000	
大同メタル工業	35,300	480.00	16,944,000	
プレス工業	80,600	421.00	33,932,600	
ミクニ	20,700	320.00	6,624,000	
太平洋工業	41,400	1,027.00	42,517,800	
河西工業	24,000	132.00	3,168,000	
アイシン	139,100	3,590.00	499,369,000	
マツダ	596,600	963.00	574,525,800	
今仙電機製作所	11,400	704.00	8,025,600	
本田技研工業	1,466,200	3,069.00	4,499,767,800	
スズキ	331,300	4,329.00	1,434,197,700	
ＳＵＢＡＲＵ	570,700	2,014.50	1,149,675,150	
安永	7,900	646.00	5,103,400	
ヤマハ発動機	283,500	3,065.00	868,927,500	
ＴＢＫ	17,900	234.00	4,188,600	
エクセディ	29,500	1,619.00	47,760,500	
豊田合成	52,600	2,040.00	107,304,000	
愛三工業	29,800	700.00	20,860,000	
盟和産業	2,600	922.00	2,397,200	
日本プラスト	14,100	405.00	5,710,500	
ヨロズ	16,900	699.00	11,813,100	
エフ・シー・シー	32,000	1,372.00	43,904,000	
シマノ	73,800	21,620.00	1,595,556,000	
テイ・エス　テック	82,600	1,530.00	126,378,000	
ジャムコ	9,800	1,378.00	13,504,400	
テルモ	563,600	3,761.00	2,119,699,600	
クリエートメディック	5,900	873.00	5,150,700	
日機装	45,100	961.00	43,341,100	
日本エム・ディ・エム	10,700	828.00	8,859,600	
島津製作所	219,700	3,810.00	837,057,000	
ＪＭＳ	16,700	494.00	8,249,800	
長野計器	13,100	1,113.00	14,580,300	
ブイ・テクノロジー	8,800	2,646.00	23,284,800	
東京計器	13,800	1,288.00	17,774,400	
愛知時計電機	7,000	1,337.00	9,359,000	
インターアクション	10,900	1,486.00	16,197,400	

オーバル	16,000	433.00	6,928,000	
東京精密	39,600	4,435.00	175,626,000	
マニー	79,300	1,843.00	146,149,900	
ニコン	280,400	1,222.00	342,648,800	
トプコン	95,000	1,545.00	146,775,000	
オリンパス	1,127,600	2,380.00	2,683,688,000	
理研計器	11,200	4,450.00	49,840,000	
タムロン	13,500	3,100.00	41,850,000	
ＨＯＹＡ	385,300	13,500.00	5,201,550,000	
シード	9,200	501.00	4,609,200	
ノーリツ鋼機	17,100	2,288.00	39,124,800	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	26,300	1,019.00	26,799,700	
朝日インテック	238,200	2,192.00	522,134,400	
シチズン時計	198,400	592.00	117,452,800	
リズム	5,600	1,551.00	8,685,600	
大研医器	13,600	454.00	6,174,400	
メニコン	61,900	2,663.00	164,839,700	
シンシア	1,700	500.00	850,000	
松風	8,200	2,289.00	18,769,800	
セイコーグループ	27,900	2,810.00	78,399,000	
ニプロ	150,400	1,016.00	152,806,400	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	26,800	118.00	3,162,400	
中本パックス	5,500	1,566.00	8,613,000	
スノーピーク	30,900	2,254.00	69,648,600	
パラマウントベッドホールディングス	41,700	2,474.00	103,165,800	
トランザクション	13,900	1,431.00	19,890,900	
粧美堂	4,900	349.00	1,710,100	
ニホンフラッシュ	16,900	903.00	15,260,700	
前田工繊	19,600	3,170.00	62,132,000	
永大産業	19,200	222.00	4,262,400	
アートネイチャー	18,600	747.00	13,894,200	
バンダイナムコホールディングス	164,700	8,319.00	1,370,139,300	
アイフィスジャパン	5,000	586.00	2,930,000	
ＳＨＯＥＩ	19,000	5,040.00	95,760,000	
フランスベッドホールディングス	22,300	966.00	21,541,800	
パイロットコーポレーション	28,200	4,485.00	126,477,000	
萩原工業	12,100	1,165.00	14,096,500	
フジシールインターナショナル	36,500	1,608.00	58,692,000	
タカラトミー	83,300	1,230.00	102,459,000	
広済堂ホールディングス	12,100	1,802.00	21,804,200	
エステールホールディングス	4,200	623.00	2,616,600	
タカノ	6,700	661.00	4,428,700	

プロネクサス	15,000	963.00	14,445,000	
ホクシン	13,800	154.00	2,125,200	
ウッドワン	6,000	895.00	5,370,000	
大建工業	11,000	2,152.00	23,672,000	
凸版印刷	235,900	1,921.00	453,163,900	
大日本印刷	214,000	2,571.00	550,194,000	
共同印刷	5,100	2,758.00	14,065,800	
ＮＩＳＳＨＡ	34,300	1,809.00	62,048,700	
光村印刷	1,500	1,164.00	1,746,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	12,400	2,070.00	25,668,000	
アシックス	166,500	2,896.00	482,184,000	
ツツミ	4,100	1,906.00	7,814,600	
ローランド	13,300	3,575.00	47,547,500	
小松ウオール工業	6,600	1,843.00	12,163,800	
ヤマハ	113,700	4,780.00	543,486,000	
河合楽器製作所	4,900	2,546.00	12,475,400	
クリナップ	20,200	639.00	12,907,800	
ピジョン	114,900	1,956.00	224,744,400	
兼松サステック	1,300	1,595.00	2,073,500	
キングジム	15,900	886.00	14,087,400	
リンテック	36,200	2,148.00	77,757,600	
イトーキ	37,000	672.00	24,864,000	
任天堂	1,138,800	5,510.00	6,274,788,000	
三菱鉛筆	25,600	1,389.00	35,558,400	
タカラスタンダード	34,900	1,346.00	46,975,400	
コクヨ	86,800	1,800.00	156,240,000	
ナカバヤシ	19,400	475.00	9,215,000	
グローブライド	14,600	2,562.00	37,405,200	
オカムラ	54,300	1,412.00	76,671,600	
美津濃	17,900	2,713.00	48,562,700	
東京電力ホールディングス	1,626,000	452.00	734,952,000	
中部電力	664,700	1,273.00	846,163,100	
関西電力	696,500	1,205.00	839,282,500	
中国電力	287,300	666.00	191,341,800	
北陸電力	170,300	510.00	86,853,000	
東北電力	441,000	661.00	291,501,000	
四国電力	154,000	712.00	109,648,000	
九州電力	415,800	709.00	294,802,200	
北海道電力	174,300	440.00	76,692,000	
沖縄電力	42,200	1,021.00	43,086,200	
電源開発	135,800	2,035.00	276,353,000	
エフオン	13,100	500.00	6,550,000	

イーレックス	32,000	2,326.00	74,432,000	
レノバ	48,000	2,343.00	112,464,000	
東京瓦斯	381,300	2,525.00	962,782,500	
大阪瓦斯	365,400	2,034.00	743,223,600	
東邦瓦斯	71,000	2,329.00	165,359,000	
北海道瓦斯	10,800	1,668.00	18,014,400	
広島ガス	38,000	339.00	12,882,000	
西部ガスホールディングス	16,900	1,703.00	28,780,700	
静岡ガス	41,100	1,031.00	42,374,100	
メタウォーター	22,600	1,601.00	36,182,600	
ＳＢＳホールディングス	16,100	2,805.00	45,160,500	
東武鉄道	198,100	3,005.00	595,290,500	
相鉄ホールディングス	59,600	2,163.00	128,914,800	
東急	505,800	1,637.00	827,994,600	
京浜急行電鉄	204,600	1,349.00	276,005,400	
小田急電鉄	273,400	1,645.00	449,743,000	
京王電鉄	95,400	4,580.00	436,932,000	
京成電鉄	116,300	3,605.00	419,261,500	
富士急行	22,200	4,545.00	100,899,000	
東日本旅客鉄道	305,900	7,347.00	2,247,447,300	
西日本旅客鉄道	230,400	5,497.00	1,266,508,800	
東海旅客鉄道	139,000	15,935.00	2,214,965,000	
西武ホールディングス	218,200	1,496.00	326,427,200	
鴻池運輸	30,700	1,477.00	45,343,900	
西日本鉄道	48,200	2,376.00	114,523,200	
ハマキョウレックス	14,100	3,045.00	42,934,500	
サカイ引越センター	8,600	4,275.00	36,765,000	
近鉄グループホールディングス	180,100	4,200.00	756,420,000	
阪急阪神ホールディングス	240,100	3,825.00	918,382,500	
南海電気鉄道	86,100	2,807.00	241,682,700	
京阪ホールディングス	74,400	3,495.00	260,028,000	
神戸電鉄	4,900	3,150.00	15,435,000	
名古屋鉄道	199,000	2,119.00	421,681,000	
山陽電気鉄道	13,600	2,160.00	29,376,000	
アルプス物流	14,400	1,155.00	16,632,000	
ヤマトホールディングス	230,600	2,046.00	471,807,600	
山九	45,800	4,675.00	214,115,000	
丸運	8,800	217.00	1,909,600	
丸全昭和運輸	11,100	2,943.00	32,667,300	
センコーグループホールディングス	95,400	973.00	92,824,200	
トナミホールディングス	4,000	3,550.00	14,200,000	
ニッコンホールディングス	57,600	2,357.00	135,763,200	

日本石油輸送	1,800	2,128.00	3,830,400	
福山通運	13,700	3,035.00	41,579,500	
セイノーホールディングス	112,100	1,164.00	130,484,400	
エスライン	5,100	783.00	3,993,300	
神奈川中央交通	5,100	3,250.00	16,575,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	43,500	1,586.00	68,991,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	17,300	1,130.00	19,549,000	
九州旅客鉄道	127,300	2,876.00	366,114,800	
ＳＧホールディングス	345,600	1,847.00	638,323,200	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	67,200	7,160.00	481,152,000	
日本郵船	482,300	3,180.00	1,533,714,000	
商船三井	317,900	3,345.00	1,063,375,500	
川崎汽船	154,000	2,787.00	429,198,000	
ＮＳユナイテッド海運	10,100	3,885.00	39,238,500	
飯野海運	67,900	886.00	60,159,400	
共栄タンカー	5,000	928.00	4,640,000	
乾汽船	23,700	1,968.00	46,641,600	
日本航空	442,300	2,723.00	1,204,382,900	
ＡＮＡホールディングス	490,000	2,865.50	1,404,095,000	
パスコ	3,500	1,389.00	4,861,500	
トランコム	5,200	7,330.00	38,116,000	
日新	13,700	2,096.00	28,715,200	
三菱倉庫	38,700	2,914.00	112,771,800	
三井倉庫ホールディングス	16,800	3,610.00	60,648,000	
住友倉庫	49,400	1,935.00	95,589,000	
澁澤倉庫	7,200	2,055.00	14,796,000	
東陽倉庫	23,900	249.00	5,951,100	
日本トランスシティ	36,200	503.00	18,208,600	
ケイヒン	3,200	1,444.00	4,620,800	
中央倉庫	8,700	952.00	8,282,400	
川西倉庫	3,000	988.00	2,964,000	
安田倉庫	12,300	929.00	11,426,700	
ファイズホールディングス	3,300	882.00	2,910,600	
東洋埠頭	5,200	1,239.00	6,442,800	
上組	86,300	2,611.00	225,329,300	
サンリツ	4,000	704.00	2,816,000	
キムラユニティー	8,600	772.00	6,639,200	
キユーソー流通システム	10,800	894.00	9,655,200	
東海運	10,500	281.00	2,950,500	
エーアイテイー	11,300	1,418.00	16,023,400	
内外トランスライン	6,500	2,126.00	13,819,000	
日本コンセプト	5,600	1,507.00	8,439,200	

ＮＥＣネッツエスアイ	60,600	1,709.00	103,565,400	
クロスキャット	10,500	1,471.00	15,445,500	
システナ	304,700	397.00	120,965,900	
デジタルアーツ	11,500	5,470.00	62,905,000	
日鉄ソリューションズ	30,900	3,250.00	100,425,000	
キューブシステム	11,000	1,051.00	11,561,000	
コア	8,200	1,471.00	12,062,200	
手間いらず	3,100	5,240.00	16,244,000	
ラクーンホールディングス	18,200	1,129.00	20,547,800	
ソリトンシステムズ	9,500	1,136.00	10,792,000	
ソフトクリエイトホールディングス	7,500	3,210.00	24,075,000	
ＴＩＳ	203,400	3,580.00	728,172,000	
ＪＮＳホールディングス	8,900	311.00	2,767,900	
グリー	97,300	684.00	66,553,200	
GMOペパボ	2,700	1,891.00	5,105,700	
コーエーテクモホールディングス	113,400	2,317.00	262,747,800	
三菱総合研究所	8,900	4,890.00	43,521,000	
電算	2,300	1,548.00	3,560,400	
ＡＧＳ	7,900	687.00	5,427,300	
ファインデックス	14,800	515.00	7,622,000	
ブレインパッド	18,300	709.00	12,974,700	
ＫＬａｂ	35,600	439.00	15,628,400	
ポールトゥウィンホールディングス	31,100	847.00	26,341,700	
ネクソン	467,700	2,939.00	1,374,570,300	
アイスタイル	58,300	491.00	28,625,300	
エムアップホールディングス	22,300	1,284.00	28,633,200	
エイチーム	13,600	763.00	10,376,800	
エニグモ	23,400	614.00	14,367,600	
テクノスジャパン	15,300	463.00	7,083,900	
コロプラ	70,500	651.00	45,895,500	
ブロードリーフ	106,100	441.00	46,790,100	
クロス・マーケティンググループ	7,600	741.00	5,631,600	
デジタルハーツホールディングス	11,400	1,727.00	19,687,800	
システム情報	16,200	825.00	13,365,000	
メディアドゥ	7,400	1,605.00	11,877,000	
じげん	53,300	374.00	19,934,200	
ブイキューブ	22,000	725.00	15,950,000	
エンカレッジ・テクノロジ	4,600	494.00	2,272,400	
サイバーリンクス	6,000	995.00	5,970,000	
フィックスターズ	20,600	1,159.00	23,875,400	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	8,600	1,635.00	14,061,000	
オプティム	15,100	1,091.00	16,474,100	

セレス	7,500	986.00	7,395,000	
ＳＨＩＦＴ	13,200	24,010.00	316,932,000	
ティーガイア	19,000	1,631.00	30,989,000	
セック	2,600	2,890.00	7,514,000	
テクマトリックス	33,200	1,748.00	58,033,600	
プロシップ	8,000	1,520.00	12,160,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	55,500	2,125.00	117,937,500	
GMOペイメントゲートウェイ	41,300	11,520.00	475,776,000	
ザッパラス	7,200	331.00	2,383,200	
システムリサーチ	5,700	2,187.00	12,465,900	
インターネットイニシアティブ	101,000	2,323.00	234,623,000	
さくらインターネット	20,700	492.00	10,184,400	
ヴィンクス	5,500	1,402.00	7,711,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,600	4,105.00	22,988,000	
ＳＲＡホールディングス	9,300	3,060.00	28,458,000	
システムインテグレータ	5,900	412.00	2,430,800	
朝日ネット	19,800	585.00	11,583,000	
ｅＢＡＳＥ	25,800	574.00	14,809,200	
アバントグループ	23,000	1,394.00	32,062,000	
アドソル日進	7,800	1,333.00	10,397,400	
ＯＤＫソリューションズ	4,300	598.00	2,571,400	
フリービット	11,300	1,062.00	12,000,600	
コムチュア	24,000	2,381.00	57,144,000	
サイバーコム	3,100	1,431.00	4,436,100	
アステリア	14,400	769.00	11,073,600	
アイル	10,300	1,857.00	19,127,100	
マークラインズ	9,900	2,604.00	25,779,600	
メディカル・データ・ビジョン	27,200	917.00	24,942,400	
ｇｕｍｉ	29,800	858.00	25,568,400	
ショーケース	4,800	308.00	1,478,400	
モバイルファクトリー	4,000	888.00	3,552,000	
テラスカイ	7,900	1,852.00	14,630,800	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,500	1,764.00	16,758,000	
ＰＣＩホールディングス	7,700	1,011.00	7,784,700	
アイビーシー	3,300	391.00	1,290,300	
ネオジャパン	6,200	1,006.00	6,237,200	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	4,600	1,791.00	8,238,600	
ラクス	85,700	1,758.00	150,660,600	
ランドコンピュータ	4,600	933.00	4,291,800	
ダブルスタンダード	7,400	2,191.00	16,213,400	
オープンドア	12,800	1,841.00	23,564,800	
マイネット	6,400	367.00	2,348,800	

アカツキ	8,700	2,205.00	19,183,500	
ベネフィットジャパン	1,300	1,226.00	1,593,800	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	5,700	2,307.00	13,149,900	
カナミックネットワーク	26,400	589.00	15,549,600	
ノムラシステムコーポレーション	18,800	116.00	2,180,800	
チェンジ	44,400	2,327.00	103,318,800	
シンクロ・フード	11,900	464.00	5,521,600	
オークネット	9,000	1,753.00	15,777,000	
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	579.00	2,200,200	
セグエグループ	5,200	846.00	4,399,200	
エイトレッド	2,900	1,432.00	4,152,800	
マクロミル	41,200	1,071.00	44,125,200	
ビーグリー	3,200	1,140.00	3,648,000	
オロ	5,600	1,860.00	10,416,000	
ユーザーローカル	6,700	1,250.00	8,375,000	
テモナ	4,300	288.00	1,238,400	
ニーズウェル	5,800	790.00	4,582,000	
マネーフォワード	43,600	4,535.00	197,726,000	
サインポスト	7,000	584.00	4,088,000	
電算システムホールディングス	8,800	2,113.00	18,594,400	
ソルクシーズ	15,300	346.00	5,293,800	
フェイス	5,500	501.00	2,755,500	
プロトコーポレーション	22,800	1,171.00	26,698,800	
ハイマックス	5,800	1,448.00	8,398,400	
野村総合研究所	371,200	3,180.00	1,180,416,000	
サイバネットシステム	15,400	985.00	15,169,000	
ＣＥホールディングス	9,700	495.00	4,801,500	
日本システム技術	7,700	1,640.00	12,628,000	
インテージホールディングス	24,700	1,501.00	37,074,700	
東邦システムサイエンス	5,300	988.00	5,236,400	
ソースネクスト	92,700	291.00	26,975,700	
インフォコム	23,400	2,114.00	49,467,600	
シンプレクス・ホールディングス	30,400	2,155.00	65,512,000	
ＨＥＲＯＺ	6,300	984.00	6,199,200	
ラクスル	25,600	2,992.00	76,595,200	
メルカリ	81,400	2,711.00	220,675,400	
ＩＰＳ	5,900	2,767.00	16,325,300	
ＦＩＧ	21,500	366.00	7,869,000	
システムサポート	7,900	1,441.00	11,383,900	
イーソル	11,900	763.00	9,079,700	
アルテリア・ネットワークス	17,000	1,236.00	21,012,000	
東海ソフト	3,200	943.00	3,017,600	

ウイングアーク１ｓｔ	18,700	1,901.00	35,548,700	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,000	1,602.00	8,010,000	
サーバーワークス	3,700	2,571.00	9,512,700	
東名	1,400	2,070.00	2,898,000	
ヴィッツ	2,000	950.00	1,900,000	
トビラシステムズ	4,800	804.00	3,859,200	
Ｓａｎｓａｎ	67,700	1,580.00	106,966,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,700	971.00	3,592,700	
ギフティ	19,600	1,911.00	37,455,600	
メドレー	18,200	4,340.00	78,988,000	
ベース	6,200	4,225.00	26,195,000	
ＪＭＤＣ	29,700	4,050.00	120,285,000	
フォーカスシステムズ	13,400	1,056.00	14,150,400	
クレスコ	14,100	1,802.00	25,408,200	
フジ・メディア・ホールディングス	174,000	1,039.00	180,786,000	
オービック	60,500	20,070.00	1,214,235,000	
ジャストシステム	26,100	3,005.00	78,430,500	
ＴＤＣソフト	15,400	1,492.00	22,976,800	
Ｚホールディングス	2,575,000	364.50	938,587,500	
トレンドマイクロ	104,500	6,150.00	642,675,000	
ＩＤホールディングス	12,400	928.00	11,507,200	
日本オラクル	34,600	8,540.00	295,484,000	
アルファシステムズ	5,700	3,960.00	22,572,000	
フューチャー	45,100	1,618.00	72,971,800	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	11,200	1,443.00	16,161,600	
ＳＢテクノロジー	7,800	1,870.00	14,586,000	
トーセ	5,000	735.00	3,675,000	
オービックビジネスコンサルタント	35,700	4,505.00	160,828,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	97,200	3,050.00	296,460,000	
アイティフォー	24,100	837.00	20,171,700	
東計電算	2,600	5,150.00	13,390,000	
エックスネット	2,700	1,001.00	2,702,700	
大塚商会	102,600	4,150.00	425,790,000	
サイボウズ	25,000	2,430.00	60,750,000	
電通国際情報サービス	22,000	4,090.00	89,980,000	
ＡＣＣＥＳＳ	21,600	929.00	20,066,400	
デジタルガレージ	32,200	4,450.00	143,290,000	
ＥＭシステムズ	30,400	849.00	25,809,600	
ウェザーニューズ	6,400	6,950.00	44,480,000	
ＣＩＪ	16,800	903.00	15,170,400	
ビジネスエンジニアリング	3,900	2,335.00	9,106,500	
日本エンタープライズ	20,400	125.00	2,550,000	

WOWOW	10,400	1,240.00	12,896,000	
スカラ	18,200	718.00	13,067,600	
インテリジェント　ウェイブ	9,900	737.00	7,296,300	
WOW　WORLD　GROUP	3,400	1,088.00	3,699,200	
ＩMAGＩCA　GROUP	15,400	657.00	10,117,800	
ネットワンシステムズ	67,500	3,480.00	234,900,000	
システムソフト	65,300	90.00	5,877,000	
アルゴグラフィックス	16,600	3,625.00	60,175,000	
マーベラス	29,700	685.00	20,344,500	
エイベックス	30,900	1,685.00	52,066,500	
ＢＩPROGY	66,600	3,300.00	219,780,000	
兼松エレクトロニクス	11,600	4,580.00	53,128,000	
都築電気	9,700	1,317.00	12,774,900	
ＴＢＳホールディングス	92,700	1,467.00	135,990,900	
日本テレビホールディングス	160,400	1,015.00	162,806,000	
朝日放送グループホールディングス	17,300	638.00	11,037,400	
テレビ朝日ホールディングス	44,100	1,289.00	56,844,900	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	160,900	490.00	78,841,000	
テレビ東京ホールディングス	13,100	1,871.00	24,510,100	
日本ＢＳ放送	6,700	910.00	6,097,000	
ビジョン	23,900	1,485.00	35,491,500	
スマートバリュー	4,900	410.00	2,009,000	
ＵSEN−NEXT　HOLDＩNGS	16,300	2,094.00	34,132,200	
ワイヤレスゲート	8,800	233.00	2,050,400	
コネクシオ	12,200	1,910.00	23,302,000	
クロップス	3,100	964.00	2,988,400	
日本電信電話	2,318,100	3,801.00	8,811,098,100	
ＫＤＤＩ	1,398,000	3,984.00	5,569,632,000	
ソフトバンク	2,906,300	1,468.50	4,267,901,550	
光通信	21,300	18,290.00	389,577,000	
エムティーアイ	16,900	505.00	8,534,500	
GMOインターネットグループ	67,300	2,491.00	167,644,300	
ファイバーゲート	10,000	910.00	9,100,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	4,900	272.00	1,332,800	
ＫADOKAWA	95,700	2,405.00	230,158,500	
学研ホールディングス	30,300	939.00	28,451,700	
ゼンリン	31,200	789.00	24,616,800	
昭文社ホールディングス	8,500	285.00	2,422,500	
インプレスホールディングス	16,900	201.00	3,396,900	
アイネット	11,100	1,326.00	14,718,600	
松竹	10,400	10,510.00	109,304,000	
東宝	113,300	4,600.00	521,180,000	

東映	5,000	16,930.00	84,650,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	567,700	1,928.00	1,094,525,600	
ピー・シー・エー	11,100	1,332.00	14,785,200	
ビジネスブレイン太田昭和	7,800	1,979.00	15,436,200	
ＤＴＳ	38,600	2,981.00	115,066,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	91,000	6,080.00	553,280,000	
シーイーシー	25,500	1,477.00	37,663,500	
カプコン	179,800	4,050.00	728,190,000	
アイ・エス・ビー	9,400	1,196.00	11,242,400	
ジャステック	11,300	1,212.00	13,695,600	
ＳＣＳＫ	147,700	2,025.00	299,092,500	
ＮＳＷ	7,100	2,025.00	14,377,500	
アイネス	12,800	1,327.00	16,985,600	
ＴＫＣ	32,500	3,465.00	112,612,500	
富士ソフト	20,500	7,600.00	155,800,000	
ＮＳＤ	64,600	2,263.00	146,189,800	
コナミグループ	77,500	6,080.00	471,200,000	
福井コンピュータホールディングス	12,600	2,759.00	34,763,400	
ＪＢＣＣホールディングス	13,300	1,813.00	24,112,900	
ミロク情報サービス	16,600	1,491.00	24,750,600	
ソフトバンクグループ	1,046,000	5,882.00	6,152,572,000	
高千穂交易	6,800	2,240.00	15,232,000	
オルバヘルスケアホールディングス	3,200	1,502.00	4,806,400	
伊藤忠食品	4,300	4,895.00	21,048,500	
エレマテック	17,200	1,632.00	28,070,400	
あらた	14,600	4,060.00	59,276,000	
トーメンデバイス	2,800	5,710.00	15,988,000	
東京エレクトロン　デバイス	7,100	7,380.00	52,398,000	
円谷フィールズホールディングス	16,400	2,375.00	38,950,000	
双日	202,600	2,504.00	507,310,400	
アルフレッサ　ホールディングス	191,600	1,604.00	307,326,400	
横浜冷凍	52,000	1,068.00	55,536,000	
ラサ商事	8,800	1,204.00	10,595,200	
アルコニックス	25,100	1,341.00	33,659,100	
神戸物産	147,700	3,820.00	564,214,000	
ハイパー	3,700	439.00	1,624,300	
あい　ホールディングス	30,600	2,099.00	64,229,400	
ディーブイエックス	5,300	1,050.00	5,565,000	
ダイワボウホールディングス	78,000	1,909.00	148,902,000	
マクニカホールディングス	46,800	3,215.00	150,462,000	
ラクト・ジャパン	7,400	1,933.00	14,304,200	
グリムス	7,900	2,051.00	16,202,900	

バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,900	835.00	23,296,500	
八洲電機	15,500	1,068.00	16,554,000	
メディアスホールディングス	12,300	714.00	8,782,200	
レスターホールディングス	18,300	2,136.00	39,088,800	
ジューテックホールディングス	4,400	1,204.00	5,297,600	
大光	8,200	625.00	5,125,000	
ＯＣＨＩホールディングス	4,400	1,292.00	5,684,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	94,300	842.00	79,400,600	
黒谷	5,300	611.00	3,238,300	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3,800	737.00	2,800,600	
三洋貿易	19,600	1,107.00	21,697,200	
ビューティガレージ	3,500	3,460.00	12,110,000	
ウイン・パートナーズ	13,900	996.00	13,844,400	
ミタチ産業	4,900	1,086.00	5,321,400	
シップヘルスケアホールディングス	68,600	2,529.00	173,489,400	
明治電機工業	7,100	1,091.00	7,746,100	
デリカフーズホールディングス	7,500	507.00	3,802,500	
スターティアホールディングス	3,800	1,041.00	3,955,800	
コメダホールディングス	46,700	2,377.00	111,005,900	
ピーバンドットコム	2,800	517.00	1,447,600	
アセンテック	6,500	477.00	3,100,500	
富士興産	4,300	1,225.00	5,267,500	
協栄産業	1,800	1,748.00	3,146,400	
フルサト・マルカホールディングス	19,000	3,300.00	62,700,000	
ヤマエグループホールディングス	10,800	1,406.00	15,184,800	
小野建	17,600	1,498.00	26,364,800	
南陽	3,600	1,956.00	7,041,600	
佐鳥電機	12,000	1,407.00	16,884,000	
エコートレーディング	3,700	744.00	2,752,800	
伯東	10,900	4,350.00	47,415,000	
コンドーテック	14,700	993.00	14,597,100	
中山福	10,300	321.00	3,306,300	
ナガイレーベン	24,100	1,876.00	45,211,600	
三菱食品	17,600	3,040.00	53,504,000	
松田産業	14,500	2,273.00	32,958,500	
第一興商	36,900	3,900.00	143,910,000	
メディパルホールディングス	198,000	1,704.00	337,392,000	
ＳＰＫ	8,500	1,444.00	12,274,000	
萩原電気ホールディングス	7,300	2,572.00	18,775,600	
アズワン	27,900	5,610.00	156,519,000	
スズデン	6,700	2,270.00	15,209,000	
尾家産業	4,500	903.00	4,063,500	

シモジマ	13,100	930.00	12,183,000	
ドウシシャ	20,200	1,615.00	32,623,000	
小津産業	4,300	1,539.00	6,617,700	
高速	9,900	1,783.00	17,651,700	
たけびし	7,300	1,551.00	11,322,300	
リックス	4,000	2,167.00	8,668,000	
丸文	17,100	1,038.00	17,749,800	
ハピネット	16,200	2,020.00	32,724,000	
橋本総業ホールディングス	7,600	1,046.00	7,949,600	
日本ライフライン	56,000	916.00	51,296,000	
タカショー	16,700	673.00	11,239,100	
ＩＤＯＭ	57,700	776.00	44,775,200	
進和	12,700	2,081.00	26,428,700	
エスケイジャパン	4,700	537.00	2,523,900	
ダイトロン	7,500	2,344.00	17,580,000	
シークス	27,200	1,294.00	35,196,800	
田中商事	5,400	566.00	3,056,400	
オーハシテクニカ	9,600	1,475.00	14,160,000	
白銅	6,900	2,610.00	18,009,000	
ダイコー通産	2,300	1,052.00	2,419,600	
伊藤忠商事	1,176,000	4,078.00	4,795,728,000	
丸紅	1,506,700	1,544.00	2,326,344,800	
高島	3,000	2,925.00	8,775,000	
長瀬産業	89,700	1,995.00	178,951,500	
蝶理	10,300	2,230.00	22,969,000	
豊田通商	167,200	5,140.00	859,408,000	
三共生興	27,500	473.00	13,007,500	
兼松	74,100	1,476.00	109,371,600	
ツカモトコーポレーション	2,700	1,376.00	3,715,200	
三井物産	1,396,400	3,842.00	5,364,968,800	
日本紙パルプ商事	10,100	4,815.00	48,631,500	
カメイ	20,300	1,285.00	26,085,500	
東都水産	1,000	5,160.00	5,160,000	
ＯＵＧホールディングス	2,800	2,331.00	6,526,800	
スターゼン	14,500	2,075.00	30,087,500	
山善	51,500	1,013.00	52,169,500	
椿本興業	3,100	3,975.00	12,322,500	
住友商事	1,181,900	2,258.00	2,668,730,200	
内田洋行	8,400	4,580.00	38,472,000	
三菱商事	1,193,200	4,312.00	5,145,078,400	
第一実業	6,700	4,420.00	29,614,000	
キヤノンマーケティングジャパン	44,200	2,943.00	130,080,600	

西華産業	7,500	1,602.00	12,015,000	
佐藤商事	13,300	1,287.00	17,117,100	
菱洋エレクトロ	16,300	2,372.00	38,663,600	
東京産業	17,500	746.00	13,055,000	
ユアサ商事	17,200	3,515.00	60,458,000	
神鋼商事	4,800	5,530.00	26,544,000	
トルク	10,400	201.00	2,090,400	
阪和興業	34,300	3,825.00	131,197,500	
正栄食品工業	12,700	4,015.00	50,990,500	
カナデン	15,500	1,124.00	17,422,000	
菱電商事	15,400	1,714.00	26,395,600	
岩谷産業	43,500	5,490.00	238,815,000	
ナイス	5,200	1,259.00	6,546,800	
ニチモウ	2,200	2,847.00	6,263,400	
極東貿易	11,400	1,425.00	16,245,000	
アステナホールディングス	33,100	405.00	13,405,500	
三愛オブリ	52,700	1,270.00	66,929,000	
稲畑産業	38,500	2,421.00	93,208,500	
ＧＳＩクレオス	11,100	1,475.00	16,372,500	
明和産業	25,400	653.00	16,586,200	
クワザワホールディングス	6,200	430.00	2,666,000	
ワキタ	35,100	1,175.00	41,242,500	
東邦ホールディングス	47,500	2,072.00	98,420,000	
サンゲツ	47,900	2,193.00	105,044,700	
ミツウロコグループホールディングス	24,600	1,088.00	26,764,800	
シナネンホールディングス	6,200	3,805.00	23,591,000	
伊藤忠エネクス	47,300	1,078.00	50,989,400	
サンリオ	54,100	4,510.00	243,991,000	
サンワテクノス	9,800	1,660.00	16,268,000	
リョーサン	20,300	2,986.00	60,615,800	
新光商事	25,700	1,232.00	31,662,400	
トーホー	8,200	1,579.00	12,947,800	
三信電気	7,700	2,383.00	18,349,100	
東陽テクニカ	21,100	1,343.00	28,337,300	
モスフードサービス	28,100	3,045.00	85,564,500	
加賀電子	15,500	4,130.00	64,015,000	
ソーダニッカ	14,000	717.00	10,038,000	
立花エレテック	14,000	1,763.00	24,682,000	
フォーバル	7,500	1,010.00	7,575,000	
ＰＡＬＴＡＣ	30,000	4,560.00	136,800,000	
三谷産業	33,500	311.00	10,418,500	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4,900	3,490.00	17,101,000	

ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	1,660.00	2,822,000	
コーア商事ホールディングス	13,400	632.00	8,468,800	
ＫＰＰグループホールディングス	44,500	759.00	33,775,500	
ヤマタネ	8,400	1,659.00	13,935,600	
丸紅建材リース	1,700	1,725.00	2,932,500	
日鉄物産	13,100	9,240.00	121,044,000	
泉州電業	9,600	3,095.00	29,712,000	
トラスコ中山	40,100	2,000.00	80,200,000	
オートバックスセブン	66,400	1,410.00	93,624,000	
モリト	13,700	960.00	13,152,000	
加藤産業	23,200	3,535.00	82,012,000	
北恵	4,300	664.00	2,855,200	
イエローハット	33,700	1,719.00	57,930,300	
ＪＫホールディングス	15,100	1,036.00	15,643,600	
日伝	11,300	1,741.00	19,673,300	
北沢産業	10,400	213.00	2,215,200	
杉本商事	8,500	1,961.00	16,668,500	
因幡電機産業	49,500	2,678.00	132,561,000	
東テク	6,400	3,485.00	22,304,000	
ミスミグループ本社	288,000	3,070.00	884,160,000	
アルテック	10,700	262.00	2,803,400	
タキヒヨー	4,700	886.00	4,164,200	
蔵王産業	3,200	1,770.00	5,664,000	
スズケン	59,400	3,325.00	197,505,000	
ジェコス	12,300	868.00	10,676,400	
グローセル	21,000	422.00	8,862,000	
ローソン	47,400	5,070.00	240,318,000	
サンエー	14,600	4,050.00	59,130,000	
カワチ薬品	15,100	2,212.00	33,401,200	
エービーシー・マート	27,900	6,810.00	189,999,000	
ハードオフコーポレーション	7,900	1,205.00	9,519,500	
アスクル	46,200	1,678.00	77,523,600	
ゲオホールディングス	20,200	1,871.00	37,794,200	
アダストリア	23,200	2,177.00	50,506,400	
くら寿司	22,400	3,030.00	67,872,000	
キャンドゥ	6,900	2,253.00	15,545,700	
ＩＫホールディングス	6,900	374.00	2,580,600	
パルグループホールディングス	18,900	2,648.00	50,047,200	
エディオン	75,800	1,278.00	96,872,400	
サーラコーポレーション	40,500	738.00	29,889,000	
ワッツ	9,800	677.00	6,634,600	
ハローズ	8,800	3,060.00	26,928,000	

フジオフードグループ本社	15,900	1,411.00	22,434,900	
あみやき亭	4,700	2,878.00	13,526,600	
大黒天物産	6,900	4,805.00	33,154,500	
ハニーズホールディングス	17,200	1,424.00	24,492,800	
ファーマライズホールディングス	4,600	610.00	2,806,000	
アルペン	15,900	1,917.00	30,480,300	
ハブ	6,700	640.00	4,288,000	
クオールホールディングス	26,500	1,141.00	30,236,500	
ジンズホールディングス	11,400	3,955.00	45,087,000	
ビックカメラ	127,200	1,209.00	153,784,800	
ＤＣＭホールディングス	116,800	1,172.00	136,889,600	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	270,700	1,943.00	525,970,100	
東京一番フーズ	5,000	477.00	2,385,000	
きちりホールディングス	5,100	570.00	2,907,000	
アークランドサービスホールディングス	15,800	2,153.00	34,017,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	237,500	1,191.00	282,862,500	
ドトール・日レスホールディングス	34,000	1,744.00	59,296,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	115,800	6,450.00	746,910,000	
ブロンコビリー	10,300	2,390.00	24,617,000	
ＺＯＺＯ	126,200	3,140.00	396,268,000	
トレジャー・ファクトリー	5,900	2,288.00	13,499,200	
物語コーポレーション	10,600	6,550.00	69,430,000	
三越伊勢丹ホールディングス	321,400	1,405.00	451,567,000	
Ｈａｍｅｅ	8,100	725.00	5,872,500	
マーケットエンタープライズ	2,300	965.00	2,219,500	
ウエルシアホールディングス	99,100	2,862.00	283,624,200	
クリエイトＳＤホールディングス	31,600	3,335.00	105,386,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	23,500	324.00	7,614,000	
ミサワ	3,900	675.00	2,632,500	
ティーライフ	2,800	1,276.00	3,572,800	
チムニー	5,900	1,108.00	6,537,200	
シュッピン	14,500	1,113.00	16,138,500	
オイシックス・ラ・大地	25,800	2,200.00	56,760,000	
ネクステージ	43,700	2,577.00	112,614,900	
ジョイフル本田	61,600	1,913.00	117,840,800	
鳥貴族ホールディングス	7,200	2,104.00	15,148,800	
ホットランド	14,800	1,410.00	20,868,000	
すかいらーくホールディングス	261,100	1,512.00	394,783,200	
ＳＦＰホールディングス	10,400	1,736.00	18,054,400	
綿半ホールディングス	15,000	1,357.00	20,355,000	
ヨシックスホールディングス	3,900	2,131.00	8,310,900	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	62,500	1,109.00	69,312,500	

ゴルフダイジェスト・オンライン	8,800	1,566.00	13,780,800	
ＢＥＥＮＯＳ	11,000	1,898.00	20,878,000	
あさひ	16,200	1,395.00	22,599,000	
日本調剤	13,200	1,156.00	15,259,200	
コスモス薬品	21,600	12,940.00	279,504,000	
トーエル	8,900	730.00	6,497,000	
セブン&アイ・ホールディングス	657,800	5,961.00	3,921,145,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	143,500	948.00	136,038,000	
ツルハホールディングス	46,800	9,430.00	441,324,000	
サンマルクホールディングス	15,600	1,707.00	26,629,200	
フェリシモ	4,600	993.00	4,567,800	
トリドールホールディングス	47,600	2,769.00	131,804,400	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	20,500	359.00	7,359,500	
ウイルプラスホールディングス	3,900	1,074.00	4,188,600	
ＪＭホールディングス	16,400	1,738.00	28,503,200	
サツドラホールディングス	9,100	755.00	6,870,500	
アレンザホールディングス	14,600	1,016.00	14,833,600	
串カツ田中ホールディングス	5,300	1,646.00	8,723,800	
バロックジャパンリミテッド	12,800	828.00	10,598,400	
クスリのアオキホールディングス	19,200	7,300.00	140,160,000	
力の源ホールディングス	11,000	1,023.00	11,253,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	109,700	2,961.00	324,821,700	
メディカルシステムネットワーク	17,300	405.00	7,006,500	
はるやまホールディングス	8,700	430.00	3,741,000	
ノジマ	62,500	1,350.00	84,375,000	
カッパ・クリエイト	30,000	1,416.00	42,480,000	
ライトオン	14,400	562.00	8,092,800	
良品計画	246,400	1,381.00	340,278,400	
パリミキホールディングス	25,100	260.00	6,526,000	
アドヴァングループ	18,500	860.00	15,910,000	
アルビス	6,400	2,369.00	15,161,600	
コナカ	20,800	336.00	6,988,800	
ハウス　オブ　ローゼ	2,600	1,618.00	4,206,800	
Ｇ－７ホールディングス	24,000	1,550.00	37,200,000	
イオン北海道	28,400	1,061.00	30,132,400	
コジマ	37,400	557.00	20,831,800	
ヒマラヤ	6,300	915.00	5,764,500	
コーナン商事	25,800	3,225.00	83,205,000	
エコス	7,200	1,851.00	13,327,200	
ワタミ	23,000	955.00	21,965,000	

パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	428,100	2,353.00	1,007,319,300	
西松屋チェーン	42,500	1,538.00	65,365,000	
ゼンショーホールディングス	104,600	3,295.00	344,657,000	
幸楽苑ホールディングス	12,400	1,060.00	13,144,000	
ハークスレイ	7,100	803.00	5,701,300	
サイゼリヤ	31,800	3,205.00	101,919,000	
ＶＴホールディングス	73,100	489.00	35,745,900	
魚力	6,100	2,145.00	13,084,500	
フジ・コーポレーション	11,000	1,313.00	14,443,000	
ユナイテッドアローズ	20,600	1,727.00	35,576,200	
ハイデイ日高	28,500	2,016.00	57,456,000	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	13,000	198.00	2,574,000	
コロワイド	87,900	1,788.00	157,165,200	
ピーシーデポコーポレーション	22,500	279.00	6,277,500	
壱番屋	15,100	4,680.00	70,668,000	
ＰＬＡＮＴ	4,900	653.00	3,199,700	
スギホールディングス	38,500	5,780.00	222,530,000	
薬王堂ホールディングス	10,800	2,630.00	28,404,000	
スクロール	28,800	720.00	20,736,000	
ヨンドシーホールディングス	16,600	1,772.00	29,415,200	
木曽路	29,000	2,114.00	61,306,000	
ＳＲＳホールディングス	31,800	888.00	28,238,400	
千趣会	35,900	395.00	14,180,500	
リテールパートナーズ	28,600	1,328.00	37,980,800	
ケーヨー	31,000	885.00	27,435,000	
上新電機	17,200	1,926.00	33,127,200	
日本瓦斯	102,400	1,998.00	204,595,200	
ロイヤルホールディングス	37,000	2,408.00	89,096,000	
いなげや	18,700	1,267.00	23,692,900	
チヨダ	18,600	784.00	14,582,400	
ライフコーポレーション	16,800	2,738.00	45,998,400	
リンガーハット	24,600	2,266.00	55,743,600	
ＭｒＭａｘＨＤ	27,200	656.00	17,843,200	
ＡＯＫＩホールディングス	36,000	674.00	24,264,000	
オークワ	30,700	883.00	27,108,100	
コメリ	29,500	2,621.00	77,319,500	
青山商事	41,200	854.00	35,184,800	
しまむら	22,400	12,430.00	278,432,000	
はせがわ	10,000	334.00	3,340,000	
高島屋	144,000	1,784.00	256,896,000	
松屋	32,600	1,090.00	35,534,000	

エイチ・ツー・オー　リテイリング	93,100	1,259.00	117,212,900	
近鉄百貨店	6,300	2,532.00	15,951,600	
丸井グループ	140,800	2,172.00	305,817,600	
アクシアル　リテイリング	13,100	3,340.00	43,754,000	
イオン	647,000	2,549.00	1,649,203,000	
イズミ	29,100	2,877.00	83,720,700	
平和堂	32,000	2,077.00	66,464,000	
フジ	29,400	1,801.00	52,949,400	
ヤオコー	21,600	6,620.00	142,992,000	
ゼビオホールディングス	26,200	907.00	23,763,400	
ケーズホールディングス	152,100	1,131.00	172,025,100	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7,700	500.00	3,850,000	
日産東京販売ホールディングス	25,400	286.00	7,264,400	
シルバーライフ	4,600	1,710.00	7,866,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	9,500	3,650.00	34,675,000	
ナルミヤ・インターナショナル	3,400	912.00	3,100,800	
ブックオフグループホールディングス	11,500	1,159.00	13,328,500	
ギフトホールディングス	4,100	4,285.00	17,568,500	
アインホールディングス	26,300	5,670.00	149,121,000	
元気寿司	6,100	2,958.00	18,043,800	
ヤマダホールディングス	783,200	461.00	361,055,200	
アークランズ	28,100	1,413.00	39,705,300	
ニトリホールディングス	77,200	16,320.00	1,259,904,000	
グルメ杵屋	15,800	1,000.00	15,800,000	
愛眼	14,100	165.00	2,326,500	
ケーユーホールディングス	11,400	1,322.00	15,070,800	
吉野家ホールディングス	74,800	2,311.00	172,862,800	
松屋フーズホールディングス	9,100	3,970.00	36,127,000	
サガミホールディングス	30,900	1,211.00	37,419,900	
関西フードマーケット	17,500	1,318.00	23,065,000	
王将フードサービス	12,600	5,900.00	74,340,000	
ミニストップ	14,000	1,401.00	19,614,000	
アークス	35,200	2,103.00	74,025,600	
バローホールディングス	36,600	1,812.00	66,319,200	
ベルク	9,600	5,400.00	51,840,000	
大庄	10,600	1,020.00	10,812,000	
ファーストリテイリング	28,600	75,440.00	2,157,584,000	
サンドラッグ	72,500	3,580.00	259,550,000	
サックスバー　ホールディングス	18,500	771.00	14,263,500	
ヤマザワ	3,700	1,275.00	4,717,500	
やまや	4,100	2,498.00	10,241,800	
ベルーナ	46,400	673.00	31,227,200	

いよぎんホールディングス	211,400	716.00	151,362,400	
しずおかフィナンシャルグループ	401,400	1,072.00	430,300,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	149,600	941.00	140,773,600	
島根銀行	6,100	487.00	2,970,700	
じもとホールディングス	11,800	432.00	5,097,600	
めぶきフィナンシャルグループ	881,500	327.00	288,250,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,700	2,761.00	62,674,700	
九州フィナンシャルグループ	312,600	461.00	144,108,600	
ゆうちょ銀行	505,800	1,129.00	571,048,200	
富山第一銀行	44,300	619.00	27,421,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	979,100	568.00	556,128,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	112,500	1,049.00	118,012,500	
三十三フィナンシャルグループ	15,900	1,637.00	26,028,300	
第四北越フィナンシャルグループ	27,900	2,875.00	80,212,500	
ひろぎんホールディングス	231,800	651.00	150,901,800	
おきなわフィナンシャルグループ	16,900	2,329.00	39,360,100	
十六フィナンシャルグループ	23,000	2,955.00	67,965,000	
北國フィナンシャルホールディングス	15,000	4,295.00	64,425,000	
プロクレアホールディングス	21,700	2,232.00	48,434,400	
あいちフィナンシャルグループ	24,800	2,327.00	57,709,600	
ＳＢＩ新生銀行	52,400	2,310.00	121,044,000	
あおぞら銀行	111,700	2,638.00	294,664,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,279,500	937.60	10,575,659,200	
りそなホールディングス	2,267,300	709.40	1,608,422,620	
三井住友トラスト・ホールディングス	322,800	4,691.00	1,514,254,800	
三井住友フィナンシャルグループ	1,298,200	5,467.00	7,097,259,400	
千葉銀行	495,100	965.00	477,771,500	
群馬銀行	344,700	492.00	169,592,400	
武蔵野銀行	22,800	2,180.00	49,704,000	
千葉興業銀行	41,600	463.00	19,260,800	
筑波銀行	78,000	233.00	18,174,000	
七十七銀行	56,900	2,181.00	124,098,900	
秋田銀行	11,900	1,788.00	21,277,200	
山形銀行	19,700	1,241.00	24,447,700	
岩手銀行	12,200	2,048.00	24,985,600	
東邦銀行	140,500	231.00	32,455,500	
東北銀行	8,700	1,006.00	8,752,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	141,800	2,989.00	423,840,200	
スルガ銀行	156,600	414.00	64,832,400	
八十二銀行	364,400	552.00	201,148,800	
山梨中央銀行	18,200	1,157.00	21,057,400	
大垣共立銀行	33,900	1,885.00	63,901,500	

福井銀行	15,900	1,563.00	24,851,700	
清水銀行	7,100	1,516.00	10,763,600	
富山銀行	2,700	1,781.00	4,808,700	
滋賀銀行	29,500	2,773.00	81,803,500	
南都銀行	26,700	2,602.00	69,473,400	
百五銀行	167,100	399.00	66,672,900	
京都銀行	56,300	5,950.00	334,985,000	
紀陽銀行	63,600	1,584.00	100,742,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	112,900	988.00	111,545,200	
山陰合同銀行	111,200	769.00	85,512,800	
鳥取銀行	5,700	1,152.00	6,566,400	
百十四銀行	16,200	1,987.00	32,189,400	
四国銀行	28,200	979.00	27,607,800	
阿波銀行	26,300	2,097.00	55,151,100	
大分銀行	10,700	2,105.00	22,523,500	
宮崎銀行	11,600	2,576.00	29,881,600	
佐賀銀行	10,400	1,756.00	18,262,400	
琉球銀行	40,700	921.00	37,484,700	
セブン銀行	636,400	264.00	168,009,600	
みずほフィナンシャルグループ	2,569,200	1,987.00	5,105,000,400	
高知銀行	6,100	723.00	4,410,300	
山口フィナンシャルグループ	196,100	872.00	170,999,200	
長野銀行	5,500	1,400.00	7,700,000	
名古屋銀行	11,700	3,435.00	40,189,500	
北洋銀行	269,200	270.00	72,684,000	
大光銀行	5,300	1,213.00	6,428,900	
愛媛銀行	23,900	895.00	21,390,500	
トマト銀行	5,800	1,018.00	5,904,400	
京葉銀行	82,500	592.00	48,840,000	
栃木銀行	81,300	303.00	24,633,900	
北日本銀行	6,200	2,213.00	13,720,600	
東和銀行	32,600	594.00	19,364,400	
福島銀行	18,700	249.00	4,656,300	
大東銀行	6,900	720.00	4,968,000	
トモニホールディングス	143,600	382.00	54,855,200	
フィデアホールディングス	18,400	1,454.00	26,753,600	
池田泉州ホールディングス	227,500	249.00	56,647,500	
ＦＰＧ	72,300	1,044.00	75,481,200	
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,700	1,160.00	17,052,000	
マーキュリアホールディングス	10,800	590.00	6,372,000	
ＳＢＩホールディングス	257,200	2,675.00	688,010,000	
ジャフコ　グループ	59,400	2,351.00	139,649,400	

大和証券グループ本社	1,270,700	595.00	756,066,500	
野村ホールディングス	3,272,100	507.60	1,660,917,960	
岡三証券グループ	156,500	413.00	64,634,500	
丸三証券	59,600	414.00	24,674,400	
東洋証券	59,700	281.00	16,775,700	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	194,000	374.00	72,556,000	
光世証券	4,700	367.00	1,724,900	
水戸証券	48,700	222.00	10,811,400	
いちよし証券	33,100	618.00	20,455,800	
松井証券	105,200	774.00	81,424,800	
マネックスグループ	198,900	475.00	94,477,500	
極東証券	22,500	596.00	13,410,000	
岩井コスモホールディングス	20,400	1,342.00	27,376,800	
アイザワ証券グループ	26,000	701.00	18,226,000	
マネーパートナーズグループ	19,300	258.00	4,979,400	
スパークス・グループ	19,900	1,684.00	33,511,600	
かんぽ生命保険	215,700	2,308.00	497,835,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	304,900	5,705.00	1,739,454,500	
アニコム　ホールディングス	60,300	594.00	35,818,200	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	361,500	4,151.00	1,500,586,500	
第一生命ホールディングス	904,300	2,987.50	2,701,596,250	
東京海上ホールディングス	1,788,900	2,727.00	4,878,330,300	
Ｔ＆Ｄホールディングス	476,800	2,009.00	957,891,200	
アドバンスクリエイト	10,300	1,132.00	11,659,600	
全国保証	46,600	4,810.00	224,146,000	
あんしん保証	10,900	257.00	2,801,300	
イントラスト	7,500	864.00	6,480,000	
日本モーゲージサービス	10,500	863.00	9,061,500	
Ｃａｓａ	7,500	858.00	6,435,000	
アルヒ	22,500	1,010.00	22,725,000	
プレミアグループ	30,200	1,562.00	47,172,400	
ネットプロテクションズホールディングス	59,800	526.00	31,454,800	
クレディセゾン	112,900	1,650.00	186,285,000	
芙蓉総合リース	16,400	8,570.00	140,548,000	
みずほリース	26,600	3,385.00	90,041,000	
東京センチュリー	33,300	4,415.00	147,019,500	
日本証券金融	71,700	1,148.00	82,311,600	
アイフル	295,700	377.00	111,478,900	
リコーリース	17,000	3,730.00	63,410,000	
イオンフィナンシャルサービス	102,400	1,282.00	131,276,800	
アコム	318,900	307.00	97,902,300	
ジャックス	19,100	4,025.00	76,877,500	

オリエントコーポレーション	46,900	1,145.00	53,700,500	
オリックス	1,188,500	2,200.50	2,615,294,250	
三菱ＨＣキャピタル	693,500	651.00	451,468,500	
九州リースサービス	9,000	775.00	6,975,000	
日本取引所グループ	499,500	1,881.50	939,809,250	
イー・ギャランティ	28,900	2,354.00	68,030,600	
アサックス	9,000	592.00	5,328,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	9,000	2,228.00	20,052,000	
大東建託	65,200	13,880.00	904,976,000	
いちご	211,100	285.00	60,163,500	
日本駐車場開発	218,200	256.00	55,859,200	
スター・マイカ・ホールディングス	18,700	639.00	11,949,300	
ＳＲＥホールディングス	9,200	3,770.00	34,684,000	
ＡＤワークスグループ	44,700	141.00	6,302,700	
ヒューリック	416,200	1,036.00	431,183,200	
三栄建築設計	9,800	1,429.00	14,004,200	
野村不動産ホールディングス	111,700	2,794.00	312,089,800	
三重交通グループホールディングス	41,800	484.00	20,231,200	
サムティ	29,100	2,003.00	58,287,300	
ディア・ライフ	30,200	606.00	18,301,200	
地主	14,600	1,867.00	27,258,200	
プレサンスコーポレーション	24,600	1,557.00	38,302,200	
ハウスコム	4,500	1,100.00	4,950,000	
ＪＰＭＣ	10,800	1,009.00	10,897,200	
サンセイランディック	7,300	808.00	5,898,400	
フージャースホールディングス	27,400	765.00	20,961,000	
オープンハウスグループ	65,400	4,855.00	317,517,000	
東急不動産ホールディングス	537,200	626.00	336,287,200	
飯田グループホールディングス	156,500	2,066.00	323,329,000	
イーグランド	3,900	1,495.00	5,830,500	
ムゲンエステート	15,500	479.00	7,424,500	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	10,600	808.00	8,564,800	
シーアールイー	9,700	1,108.00	10,747,600	
ケイアイスター不動産	9,000	4,825.00	43,425,000	
グッドコムアセット	18,800	768.00	14,438,400	
ジェイ・エス・ビー	4,800	4,205.00	20,184,000	
ロードスターキャピタル	8,700	1,577.00	13,719,900	
テンポイノベーション	7,200	1,022.00	7,358,400	
フェイスネットワーク	3,800	1,371.00	5,209,800	
パーク２４	139,400	2,161.00	301,243,400	
パラカ	7,200	1,910.00	13,752,000	
三井不動産	772,900	2,372.00	1,833,318,800	

三菱地所	1,073,100	1,652.00	1,772,761,200	
平和不動産	29,300	3,655.00	107,091,500	
東京建物	170,500	1,573.00	268,196,500	
京阪神ビルディング	23,800	1,319.00	31,392,200	
住友不動産	321,700	3,099.00	996,948,300	
テーオーシー	34,800	647.00	22,515,600	
東京楽天地	3,500	4,100.00	14,350,000	
スターツコーポレーション	26,200	2,476.00	64,871,200	
フジ住宅	27,600	675.00	18,630,000	
空港施設	24,900	511.00	12,723,900	
明和地所	11,400	833.00	9,496,200	
ゴールドクレスト	18,000	1,649.00	29,682,000	
エスリード	9,300	1,890.00	17,577,000	
日神グループホールディングス	32,700	444.00	14,518,800	
日本エスコン	39,900	769.00	30,683,100	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	89,800	373.00	33,495,400	
ＡＶＡＮＴＩＡ	11,300	785.00	8,870,500	
イオンモール	93,200	1,803.00	168,039,600	
毎日コムネット	9,200	671.00	6,173,200	
ファースト住建	9,000	1,013.00	9,117,000	
カチタス	48,400	2,943.00	142,441,200	
トーセイ	30,900	1,410.00	43,569,000	
穴吹興産	5,100	1,976.00	10,077,600	
サンフロンティア不動産	31,300	1,085.00	33,960,500	
ＦＪネクストホールディングス	20,600	985.00	20,291,000	
インテリックス	4,300	510.00	2,193,000	
ランドビジネス	6,500	221.00	1,436,500	
サンネクスタグループ	7,700	896.00	6,899,200	
グランディハウス	18,300	564.00	10,321,200	
日本空港ビルデング	63,100	6,860.00	432,866,000	
明豊ファシリティワークス	9,800	705.00	6,909,000	
日本工営	13,300	3,400.00	45,220,000	
ＬＩＦＵＬＬ	64,900	214.00	13,888,600	
ＭＩＸＩ	42,400	2,451.00	103,922,400	
ジェイエイシーリクルートメント	16,900	2,274.00	38,430,600	
日本M&Aセンターホールディングス	318,300	1,681.00	535,062,300	
メンバーズ	5,600	1,918.00	10,740,800	
中広	3,500	372.00	1,302,000	
ＵＴグループ	27,400	2,511.00	68,801,400	
アイティメディア	7,300	1,579.00	11,526,700	
Ｅ・Ｊホールディングス	12,200	1,298.00	15,835,600	
オープンアップグループ	67,900	1,908.00	129,553,200	

コシダカホールディングス	55,900	871.00	48,688,900	
アルトナー	4,800	1,029.00	4,939,200	
パソナグループ	22,700	2,065.00	46,875,500	
ＣＤＳ	4,800	1,756.00	8,428,800	
リンクアンドモチベーション	53,400	646.00	34,496,400	
エス・エム・エス	70,600	3,280.00	231,568,000	
サニーサイドアップグループ	7,100	555.00	3,940,500	
パーソルホールディングス	207,700	2,737.00	568,474,900	
リニカル	11,000	672.00	7,392,000	
クックパッド	52,400	220.00	11,528,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9,600	622.00	5,971,200	
学情	8,600	1,419.00	12,203,400	
スタジオアリス	9,400	2,145.00	20,163,000	
シミックホールディングス	10,400	1,777.00	18,480,800	
エプコ	4,400	707.00	3,110,800	
ＮＪＳ	4,200	2,083.00	8,748,600	
綜合警備保障	68,900	3,500.00	241,150,000	
カカクコム	138,600	2,137.00	296,188,200	
アイロムグループ	6,800	2,380.00	16,184,000	
セントケア・ホールディング	12,200	806.00	9,833,200	
サイネックス	3,700	556.00	2,057,200	
ルネサンス	13,400	902.00	12,086,800	
ディップ	32,500	3,870.00	125,775,000	
デジタルホールディングス	14,700	1,256.00	18,463,200	
新日本科学	19,800	2,238.00	44,312,400	
キャリアデザインセンター	4,100	1,444.00	5,920,400	
ベネフィット・ワン	86,100	1,999.00	172,113,900	
エムスリー	366,500	3,635.00	1,332,227,500	
ツカダ・グローバルホールディング	11,900	373.00	4,438,700	
アウトソーシング	110,800	965.00	106,922,000	
ウェルネット	17,100	581.00	9,935,100	
ワールドホールディングス	8,500	2,541.00	21,598,500	
ディー・エヌ・エー	79,200	1,771.00	140,263,200	
博報堂ＤＹホールディングス	236,700	1,361.00	322,148,700	
ぐるなび	35,000	382.00	13,370,000	
タカミヤ	26,100	377.00	9,839,700	
ジャパンベストレスキューシステム	11,500	839.00	9,648,500	
ファンコミュニケーションズ	37,100	414.00	15,359,400	
ライク	7,100	2,191.00	15,556,100	
ビジネス・ブレークスルー	7,900	361.00	2,851,900	
エスプール	53,800	744.00	40,027,200	
ＷＤＢホールディングス	9,600	2,062.00	19,795,200	

ティア	11,700	417.00	4,878,900	
ＣＤＧ	2,300	1,030.00	2,369,000	
アドウェイズ	26,200	489.00	12,811,800	
バリューコマース	14,100	1,922.00	27,100,200	
インフォマート	193,300	388.00	75,000,400	
ＪＰホールディングス	54,300	356.00	19,330,800	
エコナックホールディングス	36,000	86.00	3,096,000	
ＣＬホールディングス	5,500	805.00	4,427,500	
プレステージ・インターナショナル	78,400	730.00	57,232,000	
アミューズ	10,200	1,691.00	17,248,200	
ドリームインキュベータ	5,800	2,604.00	15,103,200	
クイック	14,300	2,021.00	28,900,300	
ＴＡＣ	10,600	203.00	2,151,800	
電通グループ	182,300	4,200.00	765,660,000	
イオンファンタジー	8,100	2,730.00	22,113,000	
シーティーエス	20,900	796.00	16,636,400	
ネクシィーズグループ	6,300	630.00	3,969,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	54,400	2,802.00	152,428,800	
アルプス技研	16,300	2,200.00	35,860,000	
日本空調サービス	20,400	696.00	14,198,400	
オリエンタルランド	196,300	20,055.00	3,936,796,500	
ダスキン	41,400	2,963.00	122,668,200	
明光ネットワークジャパン	24,900	606.00	15,089,400	
ファルコホールディングス	8,600	1,811.00	15,574,600	
ラウンドワン	155,800	455.00	70,889,000	
リゾートトラスト	73,300	2,309.00	169,249,700	
ビー・エム・エル	23,100	3,195.00	73,804,500	
りらいあコミュニケーションズ	30,800	1,461.00	44,998,800	
リソー教育	85,200	366.00	31,183,200	
早稲田アカデミー	10,600	1,147.00	12,158,200	
ユー・エス・エス	190,900	2,058.00	392,872,200	
東京個別指導学院	22,600	531.00	12,000,600	
サイバーエージェント	443,900	1,199.00	532,236,100	
楽天グループ	858,600	633.00	543,493,800	
クリーク・アンド・リバー社	11,000	2,110.00	23,210,000	
モーニングスター	31,000	461.00	14,291,000	
テー・オー・ダブリュー	40,800	288.00	11,750,400	
山田コンサルティンググループ	9,700	1,150.00	11,155,000	
セントラルスポーツ	7,100	2,438.00	17,309,800	
フルキャストホールディングス	17,800	2,707.00	48,184,600	
エン・ジャパン	33,700	2,381.00	80,239,700	
リソルホールディングス	1,800	4,605.00	8,289,000	

テクノプロ・ホールディングス	124,400	3,825.00	475,830,000	
アトラグループ	4,200	184.00	772,800	
インターワークス	5,700	354.00	2,017,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,800	1,809.00	17,728,200	
ＫｅｅＰｅｒ技研	13,500	3,480.00	46,980,000	
ファーストロジック	3,300	862.00	2,844,600	
三機サービス	3,600	871.00	3,135,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	12,000	577.00	6,924,000	
デザインワン・ジャパン	7,200	199.00	1,432,800	
イー・ガーディアン	7,100	2,597.00	18,438,700	
リブセンス	9,700	308.00	2,987,600	
ジャパンマテリアル	56,900	2,306.00	131,211,400	
ベクトル	29,400	1,246.00	36,632,400	
ウチヤマホールディングス	9,200	263.00	2,419,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	15,700	1,187.00	18,635,900	
キャリアリンク	6,900	2,666.00	18,395,400	
ＩＢＪ	11,700	1,009.00	11,805,300	
アサンテ	9,400	1,621.00	15,237,400	
バリューＨＲ	16,400	1,659.00	27,207,600	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	17,200	4,935.00	84,882,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,900	1,106.00	7,631,400	
ＥＲＩホールディングス	5,500	1,274.00	7,007,000	
アビスト	3,000	2,922.00	8,766,000	
シグマクシス・ホールディングス	28,400	1,259.00	35,755,600	
ウィルグループ	15,700	1,214.00	19,059,800	
エスクロー・エージェント・ジャパン	21,900	143.00	3,131,700	
メドピア	14,800	1,437.00	21,267,600	
レアジョブ	3,900	919.00	3,584,100	
リクルートホールディングス	1,372,900	4,158.00	5,708,518,200	
エラン	24,900	969.00	24,128,100	
土木管理総合試験所	8,900	304.00	2,705,600	
日本郵政	2,430,500	1,084.50	2,635,877,250	
ベルシステム２４ホールディングス	25,100	1,435.00	36,018,500	
鎌倉新書	21,400	990.00	21,186,000	
ＳＭＮ	5,200	458.00	2,381,600	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,300	711.00	2,346,300	
エアトリ	12,100	2,688.00	32,524,800	
アトラエ	14,800	1,241.00	18,366,800	
ストライク	9,200	4,635.00	42,642,000	
ソラスト	51,600	654.00	33,746,400	
セラク	6,800	1,463.00	9,948,400	
インソース	46,200	1,582.00	73,088,400	

ベイカレント・コンサルティング	146,800	5,550.00	814,740,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	4,100	2,033.00	8,335,300	
アイモバイル	9,900	1,209.00	11,969,100	
キャリアインデックス	7,400	313.00	2,316,200	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	6,400	1,051.00	6,726,400	
船場	3,600	701.00	2,523,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	66,300	1,742.00	115,494,600	
フルテック	2,900	1,050.00	3,045,000	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	6,600	338.00	2,230,800	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,700	595.00	1,606,500	
ウェルビー	14,100	724.00	10,208,400	
エル・ティー・エス	2,500	2,845.00	7,112,500	
ミダックホールディングス	11,400	2,777.00	31,657,800	
日総工産	14,500	586.00	8,497,000	
キュービーネットホールディングス	9,900	1,468.00	14,533,200	
ＲＰＡホールディングス	26,300	290.00	7,627,000	
スプリックス	6,800	859.00	5,841,200	
マネジメントソリューションズ	10,300	3,560.00	36,668,000	
プロレド・パートナーズ	5,200	494.00	2,568,800	
テノ．ホールディングス	2,800	623.00	1,744,400	
フロンティア・マネジメント	6,400	1,442.00	9,228,800	
ピアラ	3,700	534.00	1,975,800	
コプロ・ホールディングス	3,300	1,136.00	3,748,800	
ギークス	2,900	895.00	2,595,500	
カーブスホールディングス	57,400	782.00	44,886,800	
フォーラムエンジニアリング	11,200	866.00	9,699,200	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	6,600	1,156.00	7,629,600	
ダイレクトマーケティングミックス	21,500	1,636.00	35,174,000	
ポピンズ	2,900	1,880.00	5,452,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	14,600	2,390.00	34,894,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	9,300	385.00	3,580,500	
リログループ	103,400	2,138.00	221,069,200	
東祥	13,200	1,109.00	14,638,800	
ビーウィズ	5,800	1,311.00	7,603,800	
ＴＲＥホールディングス	39,300	1,448.00	56,906,400	
人・夢・技術グループ	8,500	1,429.00	12,146,500	
エイチ・アイ・エス	48,600	2,138.00	103,906,800	
ラックランド	5,900	2,916.00	17,204,400	
共立メンテナンス	31,800	5,780.00	183,804,000	
イチネンホールディングス	19,900	1,246.00	24,795,400	
建設技術研究所	9,700	3,300.00	32,010,000	
スペース	13,800	920.00	12,696,000	

燦ホールディングス	8,400	1,790.00	15,036,000	
スバル興業	1,200	9,210.00	11,052,000	
東京テアトル	6,800	1,105.00	7,514,000	
タナベコンサルティンググループ	7,700	638.00	4,912,600	
ナガワ	5,000	7,750.00	38,750,000	
東京都競馬	15,600	3,810.00	59,436,000	
カナモト	34,100	2,248.00	76,656,800	
西尾レントオール	17,300	3,025.00	52,332,500	
トランス・コスモス	23,100	3,330.00	76,923,000	
乃村工藝社	81,300	897.00	72,926,100	
藤田観光	8,200	3,415.00	28,003,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	11,100	1,705.00	18,925,500	
日本管財	19,600	2,485.00	48,706,000	
トーカイ	16,600	1,892.00	31,407,200	
セコム	188,900	7,639.00	1,443,007,100	
セントラル警備保障	10,100	2,423.00	24,472,300	
丹青社	36,400	718.00	26,135,200	
メイテック	74,100	2,459.00	182,211,900	
応用地質	17,500	2,128.00	37,240,000	
船井総研ホールディングス	39,100	2,718.00	106,273,800	
進学会ホールディングス	7,200	296.00	2,131,200	
オオバ	12,200	710.00	8,662,000	
いであ	4,300	1,670.00	7,181,000	
学究社	7,600	1,895.00	14,402,000	
ベネッセホールディングス	69,400	1,952.00	135,468,800	
イオンディライト	20,600	3,050.00	62,830,000	
ナック	8,600	948.00	8,152,800	
ダイセキ	37,900	4,365.00	165,433,500	
ステップ	7,800	1,747.00	13,626,600	
合　計	209,052,800		500,699,054,270	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	209,230,586
コール・ローン	2,168,856,219
国債証券	289,121,955,728
派生商品評価勘定	42,608,182
未収入金	116,725
未収利息	1,908,379,856
前払費用	129,050,593
差入委託証拠金	473,805,328
流動資産合計	294,054,003,217
資産合計	294,054,003,217
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,365,500
前受金	40,779,906
未払金	998,636,819
未払解約金	35,220,237
未払利息	844
流動負債合計	1,083,003,306
負債合計	1,083,003,306
純資産の部	
元本等	
元本	97,859,127,765
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	195,111,872,146
元本等合計	292,970,999,911
純資産合計	292,970,999,911
負債純資産合計	294,054,003,217

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月20日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 (1)先物取引

	2023年 1月20日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	97,859,127,765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　2.9938円 (1万口当たり純資産額)　(29,938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

	2023年 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2023年 1月20日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 1月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2023年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月21日
期首元本額	99,838,150,047円
期中追加設定元本額	19,452,040,327円
期中一部解約元本額	21,431,062,609円
期末元本額	97,859,127,765円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,247,646,942円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	540,994,084円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,236,755,754円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	8,447,944円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	8,777,978,789円
世界経済インデックスファンド	16,187,500,289円
ＤＣマイセレクション２５	1,927,873,494円
ＤＣマイセレクション５０	1,688,006,327円
ＤＣマイセレクション７５	1,177,554,601円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,323,309,132円
ＤＣマイセレクションＳ２５	981,696,360円
ＤＣマイセレクションＳ５０	781,582,220円
ＤＣマイセレクションＳ７５	458,122,897円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	24,960,450円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	93,633,191円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	48,840,775円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	13,647,623,930円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	476,062,321円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,485,612円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,003,475円
外国債券インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	20,678,589円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	37,173,409円

区分	2023年 1月20日現在
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	57,778,434円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	68,635,332円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	61,342,231円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,079,275,484円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	402,499,575円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,627,210,313円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	60,331,726円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	36,092,292円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	398,489,277円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	149,472,699円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	195,371,149円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	696,255,518円
グローバル債券ファンド・シリーズ１（適格機関投資家専用）	3,262,197,076円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	677,802,405円
外国債券ファンド・シリーズ１	734,992,118円
コア投資戦略ファンド（安定型）	191,540,029円
コア投資戦略ファンド（成長型）	956,949,109円
分散投資コア戦略ファンドＡ	276,386,697円
分散投資コア戦略ファンドＳ	590,656,608円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	615,420,989円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,336,806,318円
コア投資戦略ファンド（切替型）	139,967,722円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	253,947,315円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	109,172,323円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,386,425,129円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	191,426,369円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	10,158,748,823円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	301,490,675円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	378,083,139円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	613,577,484円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,184,071円
グローバル経済コア	861,615,355円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	18,578,003円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	1,893,109円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	102,830,030円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	21,180,418円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	21,263,099円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	24,771,487円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	11,342,613円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	16,917,804円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル債券インデックス（ノーロード）	107,813,513円
１０資産分散投資ファンド	15,676円
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	151,398,438円

区分	2023年 1月20日現在
ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	11,652,608,399円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	328,663,677円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	298,380,940円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	184,320,133円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	813,519,705円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	112,389,929円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	54,335,899円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△13,838,479,516
合計	△13,838,479,516

(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

（2023年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,968,383,495	－	2,009,163,401	40,779,906
合計		1,968,383,495	－	2,009,163,401	40,779,906

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023年 1月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)
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	2,897,910,218	－	2,891,372,994	△6,537,224
	アメリカドル	1,487,719,448	－	1,484,678,782	△3,040,666
	カナダドル	95,745,242	－	95,045,855	△699,387
	ユーロ	989,108,626	－	986,172,782	△2,935,844
	イギリスポンド	159,903,384	－	161,030,976	1,127,592
	オーストラリアドル	25,647,310	－	25,648,839	1,529
	オフショア人民元	139,786,208	－	138,795,760	△990,448
合計		2,897,910,218	－	2,891,372,994	△6,537,224

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,564,523.20	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,489,269.52	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,373,359.44	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,457,031.20	
		T 0.25% 05/31/25	10,900,000.00	10,001,601.50	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,489,003.94	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,483,234.35	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,749,671.88	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	6,827,636.70	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,264,890.61	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,231,875.04	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	6,652,187.50	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,379,375.04	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,493,684.74	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,783,281.25	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,701,367.20	

		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,192,398.45	
		T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,551,024.20	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,724,023.43	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,629,843.76	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,075,488.27	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,699,370.27	
		T 0.5% 04/30/27	11,940,000.00	10,513,729.74	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,073,369.14	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,101,418.71	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,066,669.13	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,515,185.57	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,655,957.05	
		T 0.625% 05/15/30	12,000,000.00	9,885,937.44	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,202,812.48	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,797,599.57	
		T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,777,680.46	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,181,591.80	
		T 0.625% 12/31/27	3,000,000.00	2,612,636.73	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,433,681.63	
		T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,471,484.36	
		T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,640,546.87	
		T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,630,859.36	
		T 0.75% 08/31/26	11,830,000.00	10,678,885.51	
		T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,210,308.97	
		T 0.75% 12/31/23	3,370,000.00	3,247,855.49	
		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,282,812.48	
		T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,432,109.36	
		T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,284,117.18	
		T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,417,632.80	
		T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	12,772,217.71	
		T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,005,937.50	
		T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,121,875.04	
		T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,153,582.03	
		T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,484,812.50	
		T 1.125% 08/31/28	10,210,000.00	8,990,383.64	
		T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	4,604,220.71	
		T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,141,562.48	
		T 1.25% 05/15/50	8,650,000.00	5,125,462.86	
		T 1.25% 05/31/28	8,000,000.00	7,128,124.96	
		T 1.25% 06/30/28	4,000,000.00	3,559,687.52	
		T 1.25% 08/15/31	13,380,000.00	11,314,462.50	
		T 1.25% 09/30/28	14,500,000.00	12,840,996.13	

		T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,409,101.58	
		T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,519,215.25	
		T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,791,640.64	
		T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	6,057,175.80	
		T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,134,862.50	
		T 1.375% 11/15/31	11,030,000.00	9,366,451.98	
		T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,194,960.96	
		T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,355,640.62	
		T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,534,648.46	
		T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,720,137.09	
		T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,960,644.55	
		T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,120,820.27	
		T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,384,406.27	
		T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,718,066.42	
		T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,256,343.73	
		T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,124,666.79	
		T 1.625% 05/15/31	11,150,000.00	9,768,445.31	
		T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,052,851.56	
		T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,604,546.86	
		T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,506,292.98	
		T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,443,159.37	
		T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,440,312.50	
		T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	2,002,710.94	
		T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,310,234.38	
		T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,447,203.90	
		T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,710,078.14	
		T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	10,355,718.74	
		T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	6,001,685.53	
		T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,589,062.50	
		T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,741,796.88	
		T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,886,506.65	
		T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,772,890.64	
		T 1.875% 11/15/51	9,300,000.00	6,443,156.25	
		T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,129,648.42	
		T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,544,062.48	
		T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	4,963,933.58	
		T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,190,140.58	
		T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,058,817.18	
		T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,424,218.76	
		T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,641,562.51	
		T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,827,929.70	
		T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	3,902,851.48	
		T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	8,506,345.72	

		T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	3,260,609.37	
		T 2.25% 03/31/24	5,900,000.00	5,740,976.59	
		T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,175,390.62	
		T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	6,802,578.16	
		T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	5,210,141.42	
		T 2.25% 08/15/27	11,530,000.00	10,917,468.75	
		T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,226,954.68	
		T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	4,204,277.33	
		T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,088,851.59	
		T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,811,402.29	
		T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,218,328.13	
		T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,227,158.18	
		T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,398,424.69	
		T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,212,054.67	
		T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,494,101.59	
		T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	5,621,849.97	
		T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,601,119.15	
		T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,495,898.44	
		T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,141,118.02	
		T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,516,102.11	
		T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	6,366,869.16	
		T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,850,781.25	
		T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	3,220,261.72	
		T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,394,670.11	
		T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,847,851.55	
		T 2.5% 02/15/45	4,810,000.00	3,919,210.54	
		T 2.5% 02/15/46	3,950,000.00	3,201,042.94	
		T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,697,562.50	
		T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,174,556.63	
		T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,542,521.49	
		T 2.625% 02/15/29	13,340,000.00	12,719,116.78	
		T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,043,828.12	
		T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,639,034.37	
		T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	2,940,504.24	
		T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,320,238.31	
		T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,466,990.21	
		T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,352,832.04	
		T 2.75% 08/15/32	13,800,000.00	13,081,968.75	
		T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	7,522,101.60	
		T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,431,900.38	
		T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,708,902.36	
		T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	5,193,660.95	

		T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,584,636.73	
		T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,904,218.76	
		T 2.875% 04/30/29	9,800,000.00	9,469,824.18	
		T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	7,037,095.34	
		T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,690,476.51	
		T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	3,644,056.65	
		T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	4,850,904.31	
		T 2.875% 05/15/52	5,800,000.00	5,043,281.25	
		T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,727,932.04	
		T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,331,178.12	
		T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,795,815.61	
		T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,998,664.07	
		T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,169,628.90	
		T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,115,321.07	
		T 2% 02/15/50	5,000,000.00	3,603,515.60	
		T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,034,825.81	
		T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,201,907.81	
		T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,312,656.25	
		T 2% 08/15/25	6,890,000.00	6,575,643.75	
		T 2% 08/15/51	7,850,000.00	5,617,962.87	
		T 2% 11/15/26	10,220,000.00	9,634,745.36	
		T 2% 11/15/41	8,200,000.00	6,295,582.06	
		T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	968,173.82	
		T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,830,781.24	
		T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,390,508.99	
		T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,675,190.62	
		T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	7,007,977.54	
		T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,241,515.60	
		T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	1,619,160.16	
		T 3.25% 05/15/42	1,750,000.00	1,639,394.54	
		T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,851,269.51	
		T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	5,048,250.00	
		T 3.5% 02/15/39	770,000.00	769,608.98	
		T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,363,531.25	
		T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,973,125.00	
		T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,029,296.88	
		T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	3,011,367.18	
		T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,506,980.47	
		T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,419,687.50	
		T 3% 02/15/48	4,450,000.00	3,951,634.75	
		T 3% 02/15/49	5,000,000.00	4,456,640.60	
		T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,461,986.72	
		T 3% 05/15/45	2,500,000.00	2,220,703.12	

	T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,847,119.51	
	T 3% 07/15/25	6,900,000.00	6,753,914.02	
	T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,889,326.18	
	T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,645,875.00	
	T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,109,601.55	
	T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,891,406.25	
	T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,494,187.50	
	T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,182,464.83	
	T 4.25% 05/15/39	900,000.00	984,708.98	
	T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,972,503.88	
	T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	2,557,919.91	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,107,929.69	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,101,800.78	
	T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,156,501.95	
	T 4.375% 11/15/39	2,960,000.00	3,281,206.23	
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,222,311.52	
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	617,718.75	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,914,425.77	
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,575,787.50	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	868,300.78	
	T 4% 11/15/52	5,000,000.00	5,393,750.00	
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,294,175.78	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,418,777.34	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,216,411.12	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,810,632.80	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,616,750.00	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,238,405.26	
アメリカドル 小計		1,231,230,000.00	1,116,329,077.50 (143,682,715,565)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,087,034.48	
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,293,236.00	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,801,394.96	
	CAN 0.5% 12/01/30	3,360,000.00	2,836,354.08	
	CAN 0.75% 02/01/24	1,300,000.00	1,253,549.70	
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	666,426.60	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,375,660.80	
	CAN 1.25% 03/01/27	2,980,000.00	2,794,036.08	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,980,000.00	3,596,562.82	
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,400,893.36	
	CAN 1.5% 05/01/24	1,590,000.00	1,540,751.34	
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	867,571.25	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,606,085.98	

		CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,158,572.40	
		CAN 1.5% 12/01/31	4,320,000.00	3,901,050.72	
		CAN 1.75% 12/01/53	3,090,000.00	2,393,476.92	
		CAN 1% 06/01/27	810,000.00	751,841.19	
		CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,427,148.81	
		CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,252,433.70	
		CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,250,176.00	
		CAN 2.25% 06/01/29	760,000.00	741,110.20	
		CAN 2.25% 12/01/29	510,000.00	496,802.22	
		CAN 2.5% 06/01/24	1,330,000.00	1,305,175.55	
		CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,251,175.60	
		CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	826,553.28	
		CAN 2.75% 09/01/27	760,000.00	757,552.04	
		CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	1,028,112.75	
		CAN 2.75% 12/01/64	760,000.00	741,412.68	
		CAN 2% 06/01/28	410,000.00	395,845.16	
		CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,427,322.56	
		CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	3,913,647.33	
		CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,198,730.08	
		CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,158,606.75	
		CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,135,870.64	
		CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,214,879.40	
		CAN 5.75% 06/01/29	1,020,000.00	1,200,162.60	
		CAN 5.75% 06/01/33	1,120,000.00	1,414,455.84	
		CAN 5% 06/01/37	440,000.00	548,942.68	
	カナダドル 小計		66,860,000.00	63,010,614.55 (6,022,554,538)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,490,927.50	
		MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,768,181.44	
		MBONO 5.5% 03/04/27	12,500,000.00	11,108,125.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	41,389,255.48	
		MBONO 5% 03/06/25	12,480,000.00	11,411,836.80	
		MBONO 7.5% 05/26/33	7,890,000.00	7,321,330.45	
		MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	37,369,942.20	
		MBONO 7.75% 05/29/31	50,050,000.00	47,758,711.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	25,787,337.40	
		MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	8,289,972.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	28,650,000.00	28,615,047.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	26,670,000.00	26,032,053.60	
		MBONO 8% 07/31/53	3,700,000.00	3,404,149.66	
		MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	33,346,719.90	
		MBONO 8% 11/07/47	28,400,000.00	26,107,836.00	

メキシコペソ 小計		365,620,000.00	348,201,425.43 (2,360,387,822)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,040,000.00	880,994.40	
	BGB 0.35% 06/22/32	1,910,000.00	1,563,055.89	
	BGB 0.4% 06/22/40	1,010,000.00	673,809.38	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,372,641.93	
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	314,024.90	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,680,000.00	2,578,883.60	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,580,182.11	
	BGB 0.8% 06/22/28	1,460,000.00	1,347,185.80	
	BGB 0.9% 06/22/29	2,140,000.00	1,959,499.56	
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	697,710.00	
	BGB 0% 10/22/31	1,780,000.00	1,437,179.12	
	BGB 1.25% 04/22/33	740,000.00	654,180.72	
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	745,872.75	
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	674,400.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,240,000.00	970,261.56	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,300,000.00	1,017,240.00	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	932,617.35	
	BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,395,902.35	
	BGB 1% 06/22/31	2,070,000.00	1,845,734.13	
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	758,445.60	
	BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	677,976.99	
	BGB 2.6% 06/22/24	1,730,000.00	1,728,707.69	
	BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	395,827.60	
	BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	1,067,964.57	
	BGB 3% 06/22/34	1,150,000.00	1,185,663.80	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,990,000.00	2,385,168.23	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,212,683.55	
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,207,880.64	
	BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,199,371.34	
	BGB 5% 03/28/35	2,290,000.00	2,833,078.08	
	BKO 0.2% 06/14/24	1,060,000.00	1,026,562.30	
	BKO 0.4% 09/13/24	1,820,000.00	1,759,044.92	
	BKO 0% 03/15/24	1,850,000.00	1,798,459.00	
	BKO 2.2% 12/12/24	300,000.00	298,326.69	
	BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,443,565.20	
	BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	551,718.04	
	BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,742,683.32	
	BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,773,322.31	
	BTPS 0.5% 07/15/28	2,280,000.00	1,966,267.44	
	BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,474,810.88	
	BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,067,822.00	

		BTPS 0.9% 04/01/31	4,420,000.00	3,594,034.60	
		BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	702,088.44	
		BTPS 0.95% 06/01/32	2,550,000.00	2,011,842.90	
		BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,854,842.64	
		BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,351,140.94	
		BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,710,900.04	
		BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	971,789.00	
		BTPS 0% 01/30/24	1,630,000.00	1,582,408.89	
		BTPS 0% 04/01/26	3,860,000.00	3,506,613.14	
		BTPS 0% 04/15/24	1,460,000.00	1,409,155.50	
		BTPS 0% 08/01/26	1,280,000.00	1,151,712.00	
		BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,434,888.00	
		BTPS 0% 12/15/24	2,900,000.00	2,750,648.46	
		BTPS 1.1% 04/01/27	1,000,000.00	922,268.00	
		BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,825,593.90	
		BTPS 1.35% 04/01/30	2,600,000.00	2,255,440.20	
		BTPS 1.45% 03/01/36	700,000.00	527,635.50	
		BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,233,336.04	
		BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,342,779.20	
		BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	805,443.75	
		BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,338,229.06	
		BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	2,703,948.97	
		BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,783,160.40	
		BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,212,662.58	
		BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	1,068,209.52	
		BTPS 1.75% 05/30/24	1,910,000.00	1,878,829.12	
		BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	983,960.69	
		BTPS 1.8% 03/01/41	1,360,000.00	986,054.40	
		BTPS 1.85% 05/15/24	2,450,000.00	2,416,000.86	
		BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,633,887.80	
		BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,618,094.66	
		BTPS 2.1% 07/15/26	2,640,000.00	2,560,190.16	
		BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	378,512.87	
		BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	706,721.28	
		BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,200,653.72	
		BTPS 2.25% 09/01/36	2,850,000.00	2,366,047.20	
		BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,321,344.08	
		BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	1,373,487.73	
		BTPS 2.5% 11/15/25	1,250,000.00	1,237,997.50	
		BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,934,687.43	
		BTPS 2.5% 12/01/32	2,050,000.00	1,843,556.80	
		BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,715,120.00	

		BTPS 2.7% 03/01/47	1,710,000.00	1,395,693.45	
		BTPS 2.8% 03/01/67	1,130,000.00	861,413.69	
		BTPS 2.8% 06/15/29	3,620,000.00	3,494,259.30	
		BTPS 2.8% 12/01/28	2,020,000.00	1,973,598.58	
		BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	1,045,358.46	
		BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,136,735.80	
		BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,138,147.60	
		BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,263,740.36	
		BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	879,390.72	
		BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	2,038,360.99	
		BTPS 3.35% 03/01/35	2,370,000.00	2,233,682.34	
		BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	1,962,462.80	
		BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	3,990,531.60	
		BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,179,026.07	
		BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,442,525.70	
		BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,127,515.74	
		BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	417,736.00	
		BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	2,795,980.82	
		BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,172,870.54	
		BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,831,660.51	
		BTPS 4.75% 09/01/44	2,100,000.00	2,317,627.20	
		BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	3,594,506.35	
		BTPS 5.0% 08/01/39	3,000,000.00	3,361,599.00	
		BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	3,983,996.00	
		BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,639,993.76	
		BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	3,819,846.84	
		BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	3,271,261.95	
		BTPS 5% 09/01/40	2,850,000.00	3,204,682.50	
		BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,140,702.00	
		BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,344,538.80	
		BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,613,787.00	
		DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	3,611,262.05	
		DBR 0.25% 02/15/29	2,410,000.00	2,170,691.82	
		DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,386,333.13	
		DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,964,213.56	
		DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,848,260.00	
		DBR 0.5% 02/15/28	2,860,000.00	2,648,932.00	
		DBR 0.5% 08/15/27	2,930,000.00	2,731,688.81	
		DBR 0% 02/15/30	2,470,000.00	2,150,888.35	
		DBR 0% 02/15/31	2,030,000.00	1,735,020.70	
		DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	3,059,800.26	
		DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,838,983.16	
		DBR 0% 05/15/36	2,730,000.00	2,063,366.76	

		DBR 0% 08/15/26	2,350,000.00	2,178,377.15	
		DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,072,891.50	
		DBR 0% 08/15/30	3,830,000.00	3,304,133.34	
		DBR 0% 08/15/30	1,980,000.00	1,711,315.98	
		DBR 0% 08/15/31	4,370,000.00	3,695,892.54	
		DBR 0% 08/15/50	4,780,000.00	2,837,135.54	
		DBR 0% 08/15/52	1,990,000.00	1,140,449.10	
		DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,192,897.52	
		DBR 0% 11/15/28	1,720,000.00	1,531,346.96	
		DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	3,076,014.76	
		DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,260,477.32	
		DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	3,075,030.76	
		DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,636,585.50	
		DBR 1.8% 08/15/53	850,000.00	814,598.35	
		DBR 1% 05/15/38	1,160,000.00	989,452.16	
		DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	1,955,425.74	
		DBR 1% 08/15/25	3,640,000.00	3,520,280.40	
		DBR 2.1% 11/15/29	1,600,000.00	1,605,039.04	
		DBR 2.5% 07/04/44	3,360,000.00	3,625,436.64	
		DBR 2.5% 08/15/46	3,390,000.00	3,707,714.19	
		DBR 3.25% 07/04/42	2,230,000.00	2,642,079.47	
		DBR 4.0% 01/04/37	3,190,000.00	3,913,874.80	
		DBR 4.25% 07/04/39	2,150,000.00	2,786,658.00	
		DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	2,901,244.65	
		DBR 4.75% 07/04/34	2,530,000.00	3,221,413.58	
		DBR 4.75% 07/04/40	2,030,000.00	2,799,370.00	
		DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,559,326.56	
		DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,750,818.36	
		DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,340,294.81	
		DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,590,626.25	
		DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,227,219.08	
		FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,323,991.23	
		FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,338,888.42	
		FRTR 0.5% 05/25/26	3,550,000.00	3,337,969.15	
		FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,529,506.70	
		FRTR 0.5% 05/25/40	3,210,000.00	2,216,106.96	
		FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	445,351.50	
		FRTR 0.5% 06/25/44	1,980,000.00	1,273,813.20	
		FRTR 0.75% 02/25/28	2,150,000.00	1,985,821.70	
		FRTR 0.75% 05/25/28	6,290,000.00	5,790,485.94	
		FRTR 0.75% 05/25/52	3,080,000.00	1,876,526.96	
		FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,880,414.88	

		FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,350,433.40	
		FRTR 0% 02/25/24	2,850,000.00	2,770,549.98	
		FRTR 0% 02/25/25	4,900,000.00	4,646,630.98	
		FRTR 0% 02/25/26	5,160,000.00	4,791,751.44	
		FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,148,774.64	
		FRTR 0% 03/25/24	4,260,000.00	4,131,088.14	
		FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,535,363.60	
		FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,621,818.80	
		FRTR 0% 11/25/29	6,130,000.00	5,239,813.66	
		FRTR 0% 11/25/30	8,300,000.00	6,923,652.50	
		FRTR 0% 11/25/31	5,500,000.00	4,465,026.50	
		FRTR 1.25% 05/25/34	4,390,000.00	3,812,368.19	
		FRTR 1.25% 05/25/36	5,450,000.00	4,577,575.87	
		FRTR 1.5% 05/25/31	6,170,000.00	5,791,421.14	
		FRTR 1.5% 05/25/50	3,590,000.00	2,740,713.70	
		FRTR 1.75% 05/25/66	1,380,000.00	1,070,987.95	
		FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,558,994.56	
		FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,100,819.84	
		FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,395,012.60	
		FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,077,987.20	
		FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,079,028.50	
		FRTR 2.5% 05/25/30	4,980,000.00	5,044,251.96	
		FRTR 2.5% 05/25/43	520,000.00	496,925.23	
		FRTR 2.75% 10/25/27	5,580,000.00	5,683,509.00	
		FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	3,073,412.08	
		FRTR 2% 11/25/32	2,670,000.00	2,560,927.83	
		FRTR 3.25% 05/25/45	3,230,000.00	3,485,008.50	
		FRTR 3.5% 04/25/26	5,600,000.00	5,791,800.00	
		FRTR 4.5% 04/25/41	4,300,000.00	5,344,418.40	
		FRTR 4.75% 04/25/35	2,940,000.00	3,574,510.80	
		FRTR 4% 04/25/55	2,420,000.00	3,026,026.56	
		FRTR 4% 04/25/60	2,030,000.00	2,602,455.94	
		FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	3,891,194.09	
		FRTR 5.5% 04/25/29	6,520,000.00	7,712,247.20	
		FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	5,572,872.48	
		FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,079,171.90	
		IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	850,122.30	
		IRISH 0.2% 10/18/30	1,100,000.00	934,292.70	
		IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	386,175.97	
		IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	468,361.05	
		IRISH 0.55% 04/22/41	500,000.00	342,382.50	
		IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	716,017.29	
		IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	690,014.70	

		IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,113,489.60	
		IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	597,042.36	
		IRISH 1.35% 03/18/31	790,000.00	735,548.46	
		IRISH 1.5% 05/15/50	880,000.00	681,083.04	
		IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	510,629.10	
		IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	960,205.00	
		IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,215,413.54	
		IRISH 2% 02/18/45	1,100,000.00	954,027.80	
		IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	979,473.99	
		IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,231,377.12	
		NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,192,397.13	
		NETHER 0.25% 07/15/29	750,000.00	661,323.75	
		NETHER 0.5% 01/15/40	1,780,000.00	1,322,340.64	
		NETHER 0.5% 07/15/26	1,420,000.00	1,335,119.50	
		NETHER 0.5% 07/15/32	1,570,000.00	1,331,328.60	
		NETHER 0.75% 07/15/27	1,560,000.00	1,463,109.96	
		NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,571,974.70	
		NETHER 0% 01/15/24	1,630,000.00	1,590,087.82	
		NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,109,045.49	
		NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,683,338.72	
		NETHER 0% 01/15/29	1,710,000.00	1,495,740.42	
		NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	676,906.56	
		NETHER 0% 01/15/52	1,410,000.00	773,910.93	
		NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,145,979.90	
		NETHER 0% 07/15/31	1,910,000.00	1,581,840.99	
		NETHER 2.5% 01/15/33	1,630,000.00	1,653,309.00	
		NETHER 2.75% 01/15/47	2,330,000.00	2,547,622.00	
		NETHER 2% 01/15/54	480,000.00	458,408.64	
		NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	1,975,767.52	
		NETHER 3.75% 01/15/42	1,960,000.00	2,372,086.08	
		NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	2,595,976.70	
		NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	1,988,569.26	
		OBL 0% 04/05/24	3,330,000.00	3,232,098.00	
		OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,861,878.56	
		OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,186,330.20	
		OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,331,462.45	
		OBL 0% 10/09/26	3,900,000.00	3,599,204.70	
		OBL 0% 10/10/25	5,000,000.00	4,701,740.00	
		OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,309,588.55	
		OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,423,463.80	
		RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	432,525.60	
		RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,253,708.55	

		RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	1,009,655.01	
		RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	145,429.20	
		RAGB 0.75% 02/20/28	1,210,000.00	1,114,712.50	
		RAGB 0.75% 03/20/51	860,000.00	549,732.64	
		RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	1,961,352.64	
		RAGB 0.85% 06/30/20	330,000.00	161,742.24	
		RAGB 0.9% 02/20/32	1,560,000.00	1,349,970.96	
		RAGB 0% 02/20/30	1,210,000.00	1,014,088.90	
		RAGB 0% 02/20/31	1,430,000.00	1,168,812.37	
		RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	975,142.20	
		RAGB 0% 07/15/24	1,440,000.00	1,388,083.68	
		RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	634,450.30	
		RAGB 0% 10/20/40	670,000.00	413,505.24	
		RAGB 1.2% 10/20/25	1,070,000.00	1,036,981.94	
		RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	738,016.38	
		RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	186,555.15	
		RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	975,225.34	
		RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	392,207.50	
		RAGB 2.1% 09/20/17	810,000.00	684,245.88	
		RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	713,210.00	
		RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	884,435.55	
		RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	530,428.92	
		RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,117,147.76	
		RAGB 4.85% 03/15/26	1,370,000.00	1,477,994.36	
		RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,372,473.34	
		RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	317,035.84	
		RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	244,658.24	
		RFGB 0.125% 09/15/31	540,000.00	441,238.86	
		RFGB 0.25% 09/15/40	500,000.00	331,178.62	
		RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	585,948.36	
		RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	328,976.14	
		RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	796,899.12	
		RFGB 0.5% 09/15/28	650,000.00	583,746.80	
		RFGB 0.5% 09/15/29	740,000.00	651,569.40	
		RFGB 0.75% 04/15/31	800,000.00	697,340.00	
		RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	422,911.28	
		RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	403,345.74	
		RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	275,084.64	
		RFGB 0% 09/15/30	640,000.00	530,287.74	
		RFGB 1.125% 04/15/34	530,000.00	453,489.14	
		RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	335,293.23	
		RFGB 1.375% 04/15/47	570,000.00	458,289.12	
		RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	446,778.08	

		RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	521,463.28	
		RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	559,780.65	
		RFGB 2% 04/15/24	510,000.00	506,641.65	
		RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	862,819.86	
		SPGB 0.1% 04/30/31	2,700,000.00	2,167,335.90	
		SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,209,852.29	
		SPGB 0.5% 04/30/30	3,400,000.00	2,906,908.20	
		SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,105,667.82	
		SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,064,578.10	
		SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,809,372.40	
		SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,255,267.60	
		SPGB 0.8% 07/30/29	3,000,000.00	2,656,763.18	
		SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,053,845.52	
		SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,163,941.16	
		SPGB 0% 01/31/26	3,060,000.00	2,829,153.60	
		SPGB 0% 01/31/27	1,810,000.00	1,631,550.64	
		SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,693,038.46	
		SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,036,236.51	
		SPGB 0% 05/31/25	2,310,000.00	2,172,048.17	
		SPGB 1.2% 10/31/40	2,810,000.00	2,017,742.98	
		SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,782,349.48	
		SPGB 1.3% 10/31/26	4,250,000.00	4,064,032.75	
		SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	2,038,871.24	
		SPGB 1.4% 07/30/28	3,030,000.00	2,839,446.33	
		SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,504,640.00	
		SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	2,885,040.25	
		SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	356,490.42	
		SPGB 1.5% 04/30/27	2,000,000.00	1,915,838.00	
		SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	2,985,794.45	
		SPGB 1.85% 07/30/35	2,180,000.00	1,894,149.68	
		SPGB 1.9% 10/31/52	1,190,000.00	858,651.64	
		SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,255,488.10	
		SPGB 1.95% 07/30/30	2,740,000.00	2,592,597.50	
		SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	600,127.89	
		SPGB 1% 10/31/50	2,330,000.00	1,372,041.47	
		SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	2,782,048.93	
		SPGB 2.35% 07/30/33	2,150,000.00	2,024,345.40	
		SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,908,225.00	
		SPGB 2.7% 10/31/48	1,760,000.00	1,579,265.60	
		SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,353,249.58	
		SPGB 2.9% 10/31/46	2,190,000.00	2,056,858.95	
		SPGB 3.45% 07/30/43	570,000.00	575,419.10	

		SPGB 3.45% 07/30/66	1,780,000.00	1,791,943.80	
		SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,552,150.16	
		SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	2,820,160.64	
		SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,983,207.00	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,700,000.00	2,035,960.80	
		SPGB 4.8% 01/31/24	1,840,000.00	1,877,629.84	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,030,000.00	2,476,411.21	
		SPGB 5.15% 10/31/28	3,490,000.00	3,946,984.78	
		SPGB 5.15% 10/31/44	1,740,000.00	2,244,807.06	
		SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,554,359.38	
		SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,291,179.38	
		SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,246,210.77	
	ユーロ 小計		747,450,000.00	707,509,654.77 (98,605,620,585)	
	イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,149,183.00	
		UKT 0.125% 01/31/24	3,300,000.00	3,187,426.44	
		UKT 0.125% 01/31/28	1,460,000.00	1,248,665.00	
		UKT 0.25% 01/31/25	3,960,000.00	3,708,421.20	
		UKT 0.25% 07/31/31	3,710,000.00	2,874,879.00	
		UKT 0.375% 10/22/26	2,970,000.00	2,664,684.00	
		UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,729,030.00	
		UKT 0.5% 01/31/29	1,930,000.00	1,635,482.00	
		UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	676,947.00	
		UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,598,425.00	
		UKT 0.625% 07/31/35	2,450,000.00	1,736,011.20	
		UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	515,918.90	
		UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	917,487.00	
		UKT 0.875% 07/31/33	1,260,000.00	978,377.40	
		UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,458,940.00	
		UKT 1.125% 01/31/39	1,720,000.00	1,197,481.20	
		UKT 1.125% 10/22/73	870,000.00	413,431.83	
		UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	871,410.30	
		UKT 1.25% 07/31/51	3,020,000.00	1,753,264.61	
		UKT 1.25% 10/22/41	2,460,000.00	1,658,416.87	
		UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,505,728.64	
		UKT 1.5% 07/22/47	2,370,000.00	1,540,945.56	
		UKT 1.5% 07/31/53	1,070,000.00	654,404.51	
		UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	980,655.00	
		UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	844,870.00	
		UKT 1.625% 10/22/71	1,480,000.00	882,158.73	
		UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	887,109.60	
		UKT 1.75% 07/22/57	2,060,000.00	1,338,714.89	
		UKT 1.75% 09/07/37	2,190,000.00	1,731,063.60	

	UKT 1% 01/31/32	3,600,000.00	2,947,572.00	
	UKT 1% 04/22/24	1,800,000.00	1,746,861.84	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,820,000.00	1,442,222.60	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,671,024.34	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,723,680.80	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,010,000.00	1,874,027.91	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,120,000.00	2,048,806.16	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,830,000.00	1,849,398.00	
	UKT 3.75% 01/29/38	550,000.00	556,556.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,100,000.00	1,121,285.00	
	UKT 4.125% 01/29/27	1,540,000.00	1,577,626.35	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,940,000.00	2,086,313.24	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,262,750.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,620,000.00	1,738,088.28	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,060,000.00	2,148,755.10	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,750,000.00	1,880,130.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,990,000.00	2,155,687.40	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,651,368.01	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,910,000.00	2,144,614.85	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,570,000.00	1,729,041.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,050,000.00	2,285,238.73	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,612,782.86	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	1,872,354.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,374,937.50	
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,219,443.86	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,850,000.00	2,108,900.10	
イギリスポンド 小計		101,510,000.00	89,168,998.41 (14,214,430,036)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	6,470,000.00	5,592,477.13	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	6,017,475.95	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,560,000.00	6,993,859.04	
	SGB 1% 11/12/26	9,640,000.00	9,223,241.59	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,697,505.30	
	SGB 2.5% 05/12/25	8,180,000.00	8,181,429.85	
	SGB 3.5% 03/30/39	4,440,000.00	5,533,416.60	
スウェーデンクローナ 小計		48,230,000.00	47,239,405.46 (588,602,992)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,340,000.00	3,835,475.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	6,480,000.00	5,882,738.40	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,820,000.00	4,642,937.30	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	4,075,118.55	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,570,000.00	6,412,320.00	

	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	4,000,950.00	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	3,182,061.12	
	NGB 2% 04/26/28	6,020,000.00	5,813,417.68	
	NGB 3% 03/14/24	7,530,000.00	7,517,801.24	
ノルウェークローネ 小計		47,600,000.00	45,362,819.29 (589,263,022)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,210,000.00	3,736,877.99	
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,286,447.76	
	DGB 0.5% 11/15/29	8,280,000.00	7,355,248.20	
	DGB 0% 11/15/24	3,840,000.00	3,663,187.20	
	DGB 0% 11/15/31	7,790,000.00	6,379,375.87	
	DGB 1.75% 11/15/25	8,530,000.00	8,360,376.68	
	DGB 4.5% 11/15/39	12,270,000.00	15,972,823.42	
デンマーククローネ 小計		53,770,000.00	51,754,337.12 (969,358,734)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,290,000.00	1,868,388.10	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,184,954.00	
	POLGB 0% 07/25/24	2,160,000.00	1,983,238.92	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	2,989,411.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,650,000.00	1,879,115.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,699,309.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	3,130,000.00	3,004,643.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	7,650,000.00	6,846,306.30	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,260,000.00	3,714,933.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	4,460,000.00	3,853,464.97	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,550,000.00	5,465,483.75	
	POLGB 3.25% 07/25/25	3,180,000.00	2,993,016.00	
	POLGB 3.75% 05/25/27	1,960,000.00	1,808,198.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	601,080.00	
ポーランドズロチ 小計		50,530,000.00	43,891,541.54 (1,296,200,615)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,666,902.80	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,947,678.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,810,000.00	2,569,200.05	
	ACGB 1.25% 05/21/32	3,290,000.00	2,750,755.93	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,170,000.00	1,888,824.98	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,970,000.00	1,288,212.86	
	ACGB 1.75% 11/21/32	3,050,000.00	2,651,380.18	
	ACGB 1% 11/21/31	3,610,000.00	2,979,120.29	
	ACGB 1% 12/21/30	2,360,000.00	1,992,585.17	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,421,778.76	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,760,000.00	2,635,454.53	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,450,000.00	1,445,699.62	

		ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,419,385.10	
		ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,114,544.06	
		ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,905,635.77	
		ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,630,241.03	
		ACGB 2.75% 11/21/29	2,070,000.00	2,018,137.14	
		ACGB 3.25% 04/21/25	2,560,000.00	2,580,224.25	
		ACGB 3.25% 04/21/29	2,200,000.00	2,216,842.32	
		ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,063,909.38	
		ACGB 3.75% 04/21/37	1,460,000.00	1,490,158.77	
		ACGB 3.75% 05/21/34	1,490,000.00	1,542,994.37	
		ACGB 3% 03/21/47	1,360,000.00	1,193,252.08	
		ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,781,594.29	
		ACGB 4.25% 04/21/26	2,130,000.00	2,214,696.46	
		ACGB 4.5% 04/21/33	2,310,000.00	2,544,993.06	
		ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,480,523.12	
	オーストラリアドル 小計		57,130,000.00	53,434,724.57 (4,751,950,056)	
	ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	590,000.00	487,839.95	
		NZGB 0.5% 05/15/24	1,000,000.00	945,650.39	
		NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	595,654.01	
		NZGB 1.5% 05/15/31	820,000.00	682,794.13	
		NZGB 1.75% 05/15/41	470,000.00	323,828.14	
		NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	821,206.67	
		NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	537,781.79	
		NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	402,898.42	
		NZGB 2% 05/15/32	580,000.00	494,953.35	
		NZGB 3.5% 04/14/33	540,000.00	520,455.67	
		NZGB 3% 04/20/29	830,000.00	789,166.67	
		NZGB 4.25% 05/15/34	440,000.00	449,963.58	
		NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	856,648.71	
	ニュージーランドドル 小計		8,780,000.00	7,908,841.48 (650,976,742)	
	シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	750,000.00	702,600.00	
		SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	766,665.00	
		SIGB 1.625% 07/01/31	840,000.00	765,887.61	
		SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	662,585.00	
		SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	278,915.20	
		SIGB 2.125% 06/01/26	1,080,000.00	1,055,160.00	
		SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	836,622.25	
		SIGB 2.375% 06/01/25	940,000.00	927,780.00	
		SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	408,930.00	
		SIGB 2.625% 05/01/28	610,000.00	604,937.00	
		SIGB 2.625% 08/01/32	350,000.00	345,046.49	

	SIGB 2.75% 03/01/46	760,000.00	772,160.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	637,994.70	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	652,405.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	632,709.00	
	SIGB 2% 02/01/24	680,000.00	671,398.25	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	873,575.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	760,202.00	
	SIGB 3% 08/01/72	280,000.00	312,902.96	
	SIGB 3% 09/01/24	1,210,000.00	1,208,088.20	
シンガポールドル 小計		14,200,000.00	13,876,563.66 (1,351,577,300)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	3,380,000.00	3,085,287.66	
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,923,427.20	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,509,293.83	
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	698,876.29	
	MGS 3.733% 06/15/28	3,620,000.00	3,633,656.45	
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,223,486.78	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,735,609.62	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,651,904.61	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,384,078.12	
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,167,358.68	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,147,388.77	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,003,201.19	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,509,072.18	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	608,568.36	
	MGS 3.955% 09/15/25	3,120,000.00	3,156,541.12	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,293,992.83	
	MGS 4.065% 06/15/50	2,340,000.00	2,192,792.35	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,295,064.57	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,550,967.40	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,777,237.52	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,500,000.00	2,569,419.25	
	MGS 4.498% 04/15/30	580,000.00	603,464.88	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,770,000.00	1,867,857.45	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,112,797.77	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,543,469.50	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,428,990.47	
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,013,991.50	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,785,177.24	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,109,536.18	
マレーシアリンギット 小計		53,110,000.00	53,582,509.77 (1,603,001,153)	

イスラエルシェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	2,040,000.00	1,927,315.08	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,040,429.64	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,261,142.00	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	950,000.00	810,232.20	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,970,000.00	1,579,907.69	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,187,413.83	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,830,000.00	2,439,510.37	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,610,000.00	2,494,105.29	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,750,000.00	2,613,422.90	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	3,030,000.00	3,030,429.65	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,852,436.02	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,130,000.00	2,791,700.47	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,477,256.33	
イスラエルシェケル 小計		27,120,000.00	26,505,301.47 (1,001,521,369)	
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	79,870,000.00	79,116,427.34	
	CGB 2.18% 06/25/24	22,500,000.00	22,466,353.50	
	CGB 2.28% 03/17/24	9,700,000.00	9,707,990.86	
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,016,152.50	
	CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,525,358.32	
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	19,826,287.00	
	CGB 2.5% 07/25/27	9,520,000.00	9,427,870.39	
	CGB 2.6% 09/01/32	10,800,000.00	10,492,192.11	
	CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	19,715,532.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	15,030,000.00	14,828,931.21	
	CGB 2.69% 08/12/26	17,240,000.00	17,280,019.21	
	CGB 2.75% 02/17/32	23,500,000.00	23,164,931.59	
	CGB 2.75% 06/15/29	25,700,000.00	25,559,848.13	
	CGB 2.79% 12/15/29	13,000,000.00	12,948,867.49	
	CGB 2.8% 03/24/29	19,750,000.00	19,733,933.57	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,650,000.00	11,742,611.67	
	CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	29,683,913.31	
	CGB 2.89% 11/18/31	20,780,000.00	20,772,974.48	
	CGB 2.91% 10/14/28	13,150,000.00	13,244,114.55	
	CGB 3.01% 05/13/28	10,930,000.00	11,078,849.11	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	21,985,790.86	
	CGB 3.03% 03/11/26	46,760,000.00	47,483,709.19	
	CGB 3.12% 10/25/52	6,900,000.00	6,733,977.51	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,099,976.36	
	CGB 3.28% 12/03/27	19,110,000.00	19,680,953.29	
	CGB 3.39% 03/16/50	15,920,000.00	16,169,109.79	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	7,761,466.62	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,890,000.00	8,497,915.82	

		CGB 3.81% 09/14/50	8,860,000.00	9,674,772.68	
		CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,172,083.07	
		CGB 4.08% 10/22/48	9,060,000.00	10,318,835.35	
	オフショア人民元 小計		597,820,000.00	601,911,748.88 (11,433,795,199)	
合計				289,121,955,728 (289,121,955,728)	

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　213銘柄	100.0%	49.7%
カナダドル	国債証券　38銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券　15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券　350銘柄	100.0%	34.1%
イギリスポンド	国債証券　55銘柄	100.0%	4.9%
スウェーデンクローナ	国債証券　7銘柄	100.0%	0.2%
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　7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券　14銘柄	100.0%	0.4%
オーストラリアドル	国債証券　27銘柄	100.0%	1.6%
ニュージーランドドル	国債証券　13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券　20銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリンギット	国債証券　29銘柄	100.0%	0.6%
イスラエルシェケル	国債証券　13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券　31銘柄	100.0%	4.0%

(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。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	8,472,030,038
コール・ローン	716,135,261
株式	485,195,101,079
投資信託受益証券	222,372,912
投資証券	11,488,330,326
派生商品評価勘定	170,065,787
未収入金	56,123,999
未収配当金	371,447,551
差入委託証拠金	3,273,599,671
流動資産合計	509,965,206,624
資産合計	509,965,206,624
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	136,971,517
前受金	31,329,935
未払解約金	25,912,820
未払利息	278
流動負債合計	194,214,550
負債合計	194,214,550
純資産の部	
元本等	
元本	124,064,922,029
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	385,706,070,045
元本等合計	509,770,992,074
純資産合計	509,770,992,074
負債純資産合計	509,965,206,624

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月20日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券

	2023年 1月20日現在
	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 1月20日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		124,064,922,029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	4.1089円
	(1万口当たり純資産額)	(41,089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

	2023年 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 1月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2023年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月21日
期首元本額	125,379,065,422円
期中追加設定元本額	18,294,691,504円
期中一部解約元本額	19,608,834,897円
期末元本額	124,064,922,029円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,857,489,778円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,410,575円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	33,680,584,956円
世界経済インデックスファンド	12,221,973,520円

区分	2023年 1月20日現在
外国株式インデックス・オープン	906,584,924円
ＤＣマイセレクション２５	790,889,678円
ＤＣマイセレクション５０	3,650,170,343円
ＤＣマイセレクション７５	4,380,398,216円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	12,351,858,101円
ＤＣマイセレクションＳ２５	410,124,321円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,880,749,719円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,679,807,473円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	35,169,919円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	152,334,812円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	114,042,766円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	10,187,857,170円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,195,846,362円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,091,662円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,459,609円
外国株式インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	26,183,802円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	11,072,290円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	40,738,460円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	10,417,138円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	27,941,094円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	221,282,846円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	156,544,697円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,158,239,971円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	90,086,955円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	23,089,991円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	145,137,181円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	46,640,315円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	966,793,660円
ＦＯＦｓ用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,031,914,515円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,173,742,543円
コア投資戦略ファンド（安定型）	491,761,850円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,181,204,042円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,580,128,367円
分散投資コア戦略ファンドＳ	8,402,108,841円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,419,546,321円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,159,690,263円
コア投資戦略ファンド（切替型）	366,726,441円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	584,146,294円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,177,092円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	152,058,789円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	311,714,378円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	10,351,860,472円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	225,132,145円

区分	2023年 1月20日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	870,529,583円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	162,116,032円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	4,602,728円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	469,419,593円
グローバル経済コア	644,588,355円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	14,713,152円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	5,766,779円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	456,682,822円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	92,249,421円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	57,723,175円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	51,152,961円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	20,793,307円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	28,361,571円
１０資産分散投資ファンド	34,985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）	235,976,745円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	187,286,113円
外株インデックス・ファンド２（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	888,483,139円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,443,187,978円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,588,823円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	84,904,553円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	82,725,067円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	74,587,096円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	223,103,117円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	213,286,445円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	212,187,298円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	217,861,630円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	215,611,827円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド２０２１－１１（適格機関投資家専用）	109,473,077円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2023年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△20,097,431,844
投資信託受益証券	△37,097,376
投資証券	△1,559,670,200
合計	△21,694,199,420

(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

（2023年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	13,711,091,461	－	13,742,421,396	31,329,935
合計		13,711,091,461	－	13,742,421,396	31,329,935

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,632,104,790	－	1,633,869,125	1,764,335
	アメリカドル	1,157,100,000	－	1,157,823,000	723,000
	ユーロ	236,331,700	－	236,869,930	538,230
	イギリスポンド	74,408,990	－	74,898,025	489,035
	スイスフラン	84,262,200	－	84,271,500	9,300
	オーストラリアドル	80,001,900	－	80,006,670	4,770
合計		1,632,104,790	－	1,633,869,125	1,764,335

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数（株）	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	27,671	45.16	1,249,622.36	
	BAKER HUGHES CO	83,542	30.49	2,547,195.58	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	150.59	2,747,213.37	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	90.90	771,013.80	
	CHEVRON CORP	148,184	179.00	26,524,936.00	
	CONOCOPHILLIPS	101,873	119.64	12,188,085.72	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	25.30	1,619,200.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	64.08	3,220,404.48	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	146.43	1,942,686.81	
	EOG RESOURCES INC	46,173	131.29	6,062,053.17	
	EQT CORPORATION	27,026	33.93	916,992.18	
	EXXON MOBIL	332,418	111.32	37,004,771.76	
	HALLIBURTON CO	70,302	40.19	2,825,437.38	
	HESS CORP	22,781	153.83	3,504,401.23	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	54.91	737,386.39	
	KINDER MORGAN INC	168,208	18.75	3,153,900.00	
	MARATHON OIL CORP	57,281	27.39	1,568,926.59	
	MARATHON PETROLEUM CORP	39,098	123.23	4,818,046.54	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	73,085	65.67	4,799,491.95	
	ONEOK INC	35,533	69.60	2,473,096.80	
	OVINTIV INC	20,998	49.41	1,037,511.18	
	PHILLIPS 66	37,618	104.38	3,926,566.84	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	18,288	238.38	4,359,493.44	
	SCHLUMBERGER	111,773	57.38	6,413,534.74	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	74.87	1,295,101.26	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	2,090.75	1,114,369.75	
	VALERO ENERGY CORP	30,789	138.47	4,263,352.83	
	WILLIAMS COS	98,553	31.93	3,146,797.29	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,457	299.89	5,235,179.73	
	ALBEMARLE CORP	9,440	239.11	2,257,198.40	
	ALCOA CORP	15,500	49.52	767,560.00	
	AMCOR PLC	126,534	11.75	1,486,774.50	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	186.14	1,235,597.32	
	BALL CORP	25,605	56.63	1,450,011.15	
	CELANESE CORP-SERIES A	8,582	116.58	1,000,489.56	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	85.39	1,411,240.53	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	20.38	876,340.00	

CORTEVA INC	58,500	62.22	3,639,870.00	
CROWN HOLDINGS INC	9,940	85.52	850,068.80	
DOW INC	55,796	56.60	3,158,053.60	
DUPONT DE NEMOURS INC	40,980	72.80	2,983,344.00	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	87.02	768,560.64	
ECOLAB INC	19,940	148.60	2,963,084.00	
FMC CORP	10,507	126.57	1,329,870.99	
FREEPORT-MCMORAN INC	111,600	44.14	4,926,024.00	
INT'L PAPER CO	25,191	36.63	922,746.33	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,024	112.27	2,360,364.48	
LINDE PLC	39,906	324.54	12,951,093.24	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	21,835	90.29	1,971,482.15	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,192	343.10	1,781,375.20	
MOSAIC CO/THE	27,732	46.72	1,295,639.04	
NEWMONT CORPORATION	61,808	52.47	3,243,065.76	
NUCOR CORP	20,956	150.80	3,160,164.80	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	129.77	997,541.99	
PPG INDUSTRIES INC	19,278	123.60	2,382,760.80	
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	83.67	874,853.52	
SEALED AIR CORP	11,690	53.38	624,012.20	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,339	234.34	4,531,901.26	
STEEL DYNAMICS INC	15,552	107.33	1,669,196.16	
VULCAN MATERIALS CO	10,153	176.67	1,793,730.51	
WESTLAKE CORP	2,222	110.56	245,664.32	
WESTROCK CO	21,356	36.45	778,426.20	
3 M COMPANY	45,028	118.43	5,332,666.04	
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	61.67	678,678.35	
ALLEGION PLC	7,601	108.26	822,884.26	
AMETEK INC	17,753	139.03	2,468,199.59	
BOEING CO	44,686	207.09	9,254,023.74	
CARLISLE COS INC	4,378	233.92	1,024,101.76	
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	41.91	2,856,501.78	
CATERPILLAR	42,201	245.75	10,370,895.75	
CUMMINS INC	11,372	235.48	2,677,878.56	
DEERE&CO	23,165	408.60	9,465,219.00	
DOVER CORP	12,041	135.88	1,636,131.08	
EATON CORP	31,311	151.86	4,754,888.46	
EMERSON ELECTRIC CO	46,386	86.89	4,030,479.54	
FASTENAL CO	47,949	46.80	2,244,013.20	
FERGUSON PLC	16,011	135.21	2,164,847.31	
FORTIVE CORP	28,348	65.12	1,846,021.76	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	59.86	617,156.60	

GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	63.94	1,913,148.74	
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	105.32	548,822.52	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,970	231.55	4,392,503.50	
GENERAL ELECTRIC CO	89,763	76.86	6,899,184.18	
GRAINGER (WW) INC	3,667	547.73	2,008,525.91	
HEICO CORP	3,640	160.50	584,220.00	
HEICO CORP-CLASS A	6,449	125.79	811,219.71	
HONEYWELL INTL INC	53,841	200.66	10,803,735.06	
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	38.43	1,214,157.42	
HUBBELL INC	4,432	223.55	990,773.60	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	217.71	766,774.62	
IDEX CORP	5,916	226.47	1,339,796.52	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,371	220.99	5,385,747.29	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	53.88	1,700,560.56	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	51.89	659,003.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	53,782	64.83	3,486,687.06	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,684	191.45	3,002,701.80	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	233.14	588,911.64	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,902	439.31	8,303,837.62	
MASCO CORP	19,462	48.24	938,846.88	
NORDSON CORP	4,121	228.37	941,112.77	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,590	442.31	5,126,372.90	
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	79.65	2,696,789.70	
OWENS CORNING	8,642	86.69	749,174.98	
PACCAR INC	28,106	98.01	2,754,669.06	
PARKER HANNIFIN CORP	10,579	297.81	3,150,531.99	
PENTAIR PLC	14,533	48.03	698,019.99	
PLUG POWER INC	41,884	15.31	641,244.04	
QUANTA SERVICES INC	11,465	143.49	1,645,112.85	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	118,485	94.24	11,166,026.40	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,188	265.32	2,437,760.16	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	43.68	604,007.04	
SMITH (A.O.) CORP	9,016	57.79	521,034.64	
SNAP-ON INC	4,000	234.49	937,960.00	
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	83.40	1,050,673.20	
TEXTRON	16,934	66.42	1,124,756.28	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	167.05	3,113,477.90	
TRANSDIGM GROUP INC	3,986	660.24	2,631,716.64	
UNITED RENTALS INC	5,364	373.33	2,002,542.12	
WABTEC CORP	12,976	100.08	1,298,638.08	
XYLEM INC	15,077	108.63	1,637,814.51	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	92.51	1,051,283.64	

CINTAS CORP	7,423	427.59	3,174,000.57	
CLARIVATE PLC	27,357	10.43	285,333.51	
COPART INC	32,281	61.51	1,985,604.31	
COSTAR GROUP INC	32,116	76.62	2,460,727.92	
EQUIFAX INC	9,230	217.45	2,007,063.50	
JACOBS SOLUTIONS INC	10,661	118.65	1,264,927.65	
LEIDOS HOLDINGS	11,220	94.57	1,061,075.40	
REPUBLIC SERVICES INC	18,296	121.62	2,225,159.52	
ROBERT HALF INTL INC	9,566	75.72	724,337.52	
ROLLINS INC	17,468	35.83	625,878.44	
TRANSUNION	15,741	65.36	1,028,831.76	
VERISK ANALYTICS INC	12,079	178.31	2,153,806.49	
WASTE CONNECTIONS INC	21,275	127.35	2,709,371.25	
WASTE MANAGEMENT INC	32,506	150.49	4,891,827.94	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,277	92.79	953,602.83	
CSX CORP	169,261	31.55	5,340,184.55	
DELTA AIR LINES INC	14,609	38.35	560,255.15	
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	105.51	1,295,662.80	
FEDEX CORP	19,274	184.23	3,550,849.02	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	83,011	3.59	298,009.49	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	184.83	1,303,421.16	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,697	55.63	761,964.11	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	249.88	4,769,459.56	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,302	310.74	2,269,023.48	
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	36.45	493,277.85	
U-HAUL HOLDING CO	6,606	58.68	387,640.08	
UBER TECHNOLOGIES INC	120,334	29.03	3,493,296.02	
UNION PACIFIC CORP	49,838	205.50	10,241,709.00	
UNITED PARCEL SERVICE B	58,729	176.15	10,345,113.35	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	7,175	17.51	125,634.25	
APTIV PLC	22,415	101.10	2,266,156.50	
BORGWARNER INC	19,781	43.70	864,429.70	
FORD MOTOR COMPANY	321,972	12.18	3,921,618.96	
GENERAL MOTORS CO	108,298	35.73	3,869,487.54	
LEAR CORP	5,287	134.29	709,991.23	
LUCID GROUP INC	31,234	7.45	232,693.30	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	26,935	15.79	425,303.65	
TESLA INC	212,202	127.17	26,985,728.34	
DR HORTON INC	25,466	92.02	2,343,381.32	
GARMIN LTD	12,854	95.34	1,225,500.36	
HASBRO INC	10,572	61.54	650,600.88	
LENNAR CORP-CL A	20,844	95.70	1,994,770.80	

LULULEMON ATHLETICA INC	9,374	307.94	2,886,629.56	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	111.37	463,633.31	
NEWELL BRANDS INC	31,461	14.83	466,566.63	
NIKE B	101,374	124.53	12,624,104.22	
NVR INC	247	4,928.90	1,217,438.30	
PULTE GROUP INC	16,747	50.18	840,364.46	
VF CORP	25,718	28.42	730,905.56	
WHIRLPOOL CORP	3,785	145.49	550,679.65	
AIRBNB INC-CLASS A	31,141	99.10	3,086,073.10	
ARAMARK	20,955	44.26	927,468.30	
BOOKING HOLDINGS INC	3,135	2,315.40	7,258,779.00	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	45.52	799,331.20	
CARNIVAL CORPORATION	84,361	10.12	853,733.32	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,159	1,504.14	3,247,438.26	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	145.39	1,338,605.73	
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	348.85	993,524.80	
EXPEDIA GROUP INC	11,638	107.07	1,246,080.66	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	22,125	135.06	2,988,202.50	
LAS VEGAS SANDS CORP	29,096	54.37	1,581,949.52	
MARRIOTT INTL A	21,339	161.03	3,436,219.17	
MCDONALD'S CORP	59,058	263.58	15,566,507.64	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	38.16	868,292.64	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,179	60.78	1,226,479.62	
STARBUCKS CORP	90,925	104.26	9,479,840.50	
VAIL RESORTS INC	3,014	245.33	739,424.62	
WYNN RESORTS LTD	9,302	98.93	920,246.86	
YUM BRANDS INC	21,705	126.05	2,735,915.25	
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,442	73.76	4,531,961.92	
ALPHABET INC-CL A	478,431	93.05	44,518,004.55	
ALPHABET INC-CL C	442,515	93.91	41,556,583.65	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	8,752	384.20	3,362,518.40	
COMCAST CORP-CL A	349,773	38.14	13,340,342.22	
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	13.21	265,943.72	
ELECTRONIC ARTS INC	21,551	123.72	2,666,289.72	
FOX CORP - CLASS A	27,658	31.31	865,971.98	
FOX CORP- CLASS B	10,345	29.41	304,246.45	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	35.30	1,194,340.20	
LIBERTY BROADBAND-C	11,268	87.45	985,386.60	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	66.11	1,016,705.69	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	39.93	542,409.12	
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	40.19	256,572.96	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	14,491	73.22	1,061,031.02	

MATCH GROUP INC	22,730	47.84	1,087,403.20	
META PLATFORMS INC-CLASS A	181,679	136.15	24,735,595.85	
NETFLIX INC	35,601	315.78	11,242,083.78	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	18.71	626,392.09	
OMNICOM GROUP	16,538	82.11	1,357,935.18	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	19.57	950,828.02	
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	26.77	1,225,182.59	
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	33.41	937,451.19	
ROKU INC	9,122	49.94	455,552.68	
SEA LTD-ADR	28,338	61.32	1,737,686.16	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	5.79	350,109.72	
SNAP INC - A	83,375	9.62	802,067.50	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	12,867	102.26	1,315,779.42	
THE WALT DISNEY CO	144,835	99.08	14,350,251.80	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	44.26	1,623,058.46	
WARNER BROS DISCOVERY INC	192,233	12.47	2,397,145.51	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	25.63	562,194.05	
ADVANCE AUTO PARTS	5,324	143.27	762,769.48	
AMAZON.COM	732,070	93.68	68,580,317.60	
AUTOZONE INC	1,572	2,327.54	3,658,892.88	
BATH & BODY WORKS INC	19,806	44.25	876,415.50	
BEST BUY COMPANY INC	15,285	81.52	1,246,033.20	
BURLINGTON STORES INC	5,108	222.93	1,138,726.44	
CARMAX INC	13,591	62.19	845,224.29	
CHEWY INC - CLASS A	6,878	39.90	274,432.20	
DOLLAR GENERAL CORP	17,687	224.47	3,970,200.89	
DOLLAR TREE INC	17,931	142.81	2,560,726.11	
DOORDASH INC - A	19,212	54.65	1,049,935.80	
EBAY	41,952	45.54	1,910,494.08	
ETSY INC	10,294	128.97	1,327,617.18	
GENUINE PARTS CO	11,319	161.37	1,826,547.03	
HOME DEPOT	81,584	310.88	25,362,833.92	
LKQ CORP	19,286	55.01	1,060,922.86	
LOWES COMPANIES	49,752	202.13	10,056,371.76	
MERCADOLIBRE INC	3,725	1,072.74	3,995,956.50	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,175	793.73	4,107,552.75	
POOL CORP	3,304	344.78	1,139,153.12	
ROSS STORES INC	28,076	115.75	3,249,797.00	
TARGET (DAYTON HUDSON)	36,243	159.10	5,766,261.30	
TJX COMPANIES INC	91,766	79.41	7,287,138.06	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	206.86	1,845,604.92	
ULTA BEAUTY INC	3,920	488.12	1,913,430.40	

COSTCO WHOLESALE CORP	35,343	469.49	16,593,185.07	
KROGER CO	56,126	44.00	2,469,544.00	
SYSCO CORP	39,357	76.97	3,029,308.29	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	35.41	2,116,349.47	
WALMART INC	119,948	138.83	16,652,380.84	
ALTRIA GROUP INC	142,110	44.54	6,329,579.40	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	43,835	85.31	3,739,563.85	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	65.90	1,581,995.40	
BUNGE LIMITED	11,604	98.39	1,141,717.56	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	52.39	831,376.91	
COCA-COLA CO	327,127	59.72	19,536,024.44	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	55.80	858,985.20	
CONAGRA BRANDS INC	40,304	38.27	1,542,434.08	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	216.59	2,802,674.60	
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	64.61	855,565.62	
GENERAL MILLS INC	46,616	77.45	3,610,409.20	
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	216.12	2,597,546.28	
HORMEL FOODS CORP	23,338	44.46	1,037,607.48	
JM SMUCKER CO	9,145	150.06	1,372,298.70	
KELLOGG CO	21,630	67.31	1,455,915.30	
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	34.36	2,135,645.80	
KRAFT HEINZ CO/THE	56,727	40.04	2,271,349.08	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	95.64	1,135,820.64	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	76.65	1,593,553.50	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	49.59	727,435.71	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,308	63.84	6,914,382.72	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,267	99.86	3,222,182.62	
PEPSICO INC	109,867	169.63	18,636,739.21	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	123,101	101.19	12,456,590.19	
TYSON FOODS INC	23,306	63.49	1,479,697.94	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	80.55	1,558,320.30	
CLOROX COMPANY	9,570	139.79	1,337,790.30	
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,289	75.20	4,684,132.80	
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,174	259.51	4,716,334.74	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,373	132.16	3,485,455.68	
PROCTER & GAMBLE CO	190,677	142.42	27,156,218.34	
ABBOTT LABORATORIES	139,251	111.80	15,568,261.80	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	236.30	1,404,330.90	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	162.94	2,101,274.24	
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	43.64	1,746,167.32	
BECTON DICKINSON & CO	22,473	253.96	5,707,243.08	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,818	45.46	5,310,546.28	

CARDINAL HEALTH	21,902	75.48	1,653,162.96	
CENTENE CORP	45,335	75.86	3,439,113.10	
CIGNA CORP	24,609	310.66	7,645,031.94	
CVS HEALTH CORP	105,886	87.48	9,262,907.28	
DAVITA INC	4,627	79.53	367,985.31	
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	36.62	650,883.88	
DEXCOM INC	30,645	106.20	3,254,499.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,456	78.47	3,802,342.32	
ELEVANCE HEALTH INC	19,014	480.22	9,130,903.08	
HCA HEALTHCARE INC	18,595	256.98	4,778,543.10	
HENRY SCHEIN INC	11,747	80.22	942,344.34	
HOLOGIC INC	18,875	78.76	1,486,595.00	
HUMANA INC	9,946	491.72	4,890,647.12	
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	475.13	3,207,602.63	
INSULET CORP	5,246	292.38	1,533,825.48	
INTUITIVE SURGICAL INC	28,238	252.50	7,130,095.00	
LABORATORY CRP OF AMER	7,595	252.59	1,918,421.05	
MASIMO CORP	4,147	163.00	675,961.00	
MCKESSON CORP	11,489	378.72	4,351,114.08	
MEDTRONIC PLC	105,263	79.52	8,370,513.76	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	298.07	1,354,728.15	
NOVOCURE LTD	7,933	88.03	698,341.99	
QUEST DIAGNOSTICS	10,005	145.30	1,453,726.50	
RESMED INC	12,169	229.30	2,790,351.70	
STERIS PLC	8,018	199.17	1,596,945.06	
STRYKER CORP	26,887	253.31	6,810,745.97	
TELEFLEX INC	3,934	235.20	925,276.80	
THE COOPER COS INC	4,134	342.39	1,415,440.26	
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,618	484.36	36,141,974.48	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	146.29	683,466.88	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	158.27	1,781,328.85	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,923	121.95	2,063,759.85	
ABBVIE INC	140,845	148.71	20,945,059.95	
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	152.87	3,636,012.95	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	228.56	2,204,004.08	
AMGEN	42,448	262.03	11,122,649.44	
AVANTOR INC	58,029	22.65	1,314,356.85	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	450.55	834,869.15	
BIO-TECHNE CORP	12,980	80.79	1,048,654.20	
BIOGEN INC	11,860	280.13	3,322,341.80	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	109.20	1,614,303.60	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	171,311	73.75	12,634,186.25	

CATALENT INC	13,739	49.29	677,195.31	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	233.53	981,760.12	
DANAHER CORP	54,935	270.78	14,875,299.30	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	12.94	466,629.34	
EXACT SCIENCES CORP	14,756	66.19	976,699.64	
GILEAD SCIENCES INC	101,090	83.62	8,453,145.80	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	113.06	2,026,713.56	
ILLUMINA INC	12,687	196.38	2,491,473.06	
INCYTE CORP	15,212	83.88	1,275,982.56	
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	222.29	3,362,358.54	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	156.12	776,072.52	
JOHNSON & JOHNSON	209,738	169.53	35,556,883.14	
LILLY (ELI) & CO	64,340	351.08	22,588,487.20	
MERCK & CO	201,784	109.90	22,176,061.60	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,518.46	2,745,375.68	
MODERNA INC	26,107	190.38	4,970,250.66	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	109.97	931,885.78	
PERKINELMER INC	10,545	133.01	1,402,590.45	
PFIZER	447,027	44.96	20,098,333.92	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,615	715.57	6,164,635.55	
REPLIGEN CORP	4,353	184.11	801,430.83	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,752	38.18	1,174,111.36	
SEAGEN INC	10,981	132.00	1,449,492.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	10.55	972,087.55	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,174	583.86	18,201,251.64	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,685	307.94	6,369,738.90	
VIATRIS INC	89,720	11.52	1,033,574.40	
WATERS CORP	4,749	332.04	1,576,857.96	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	254.78	1,469,316.26	
ZOETIS INC	36,859	161.95	5,969,315.05	
BANK OF AMERICA CORP	575,705	33.23	19,130,677.15	
CITIGROUP	153,036	49.37	7,555,387.32	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	40.27	1,591,550.94	
FIFTH THIRD BANCORP	57,420	33.64	1,931,608.80	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	790.23	750,718.50	
FIRST HORIZON CORP	44,308	24.60	1,089,976.80	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,984	130.99	1,962,754.16	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	14.02	1,599,850.24	
JPMORGAN CHASE & CO	233,844	134.75	31,510,479.00	
KEY CORP	82,287	16.45	1,353,621.15	
M & T BANK CORP	14,929	153.81	2,296,229.49	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	33,294	148.02	4,928,177.88	

REGIONS FINL CORP	79,314	21.69	1,720,320.66	
SIGNATURE BANK	4,686	118.91	557,212.26	
SVB FINANCIAL GROUP	4,545	250.04	1,136,431.80	
TRUIST FINANCIAL CORP	104,155	47.71	4,969,235.05	
US BANCORP	111,007	45.63	5,065,249.41	
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	45.15	644,425.95	
WELLS FARGO & CO	304,746	42.95	13,088,840.70	
ALLY FINANCIAL INC	27,761	26.19	727,060.59	
AMERICAN EXPRESS	50,389	146.85	7,399,624.65	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	323.17	2,812,225.34	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	65.78	2,095,356.12	
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	75.93	970,385.40	
BANK NEW YORK CO	61,254	48.92	2,996,545.68	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,759	305.23	31,670,359.57	
BLACKROCK INC	11,937	729.87	8,712,458.19	
BLACKSTONE INC	57,841	80.52	4,657,357.32	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	31,266	97.91	3,061,254.06	
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	32.88	515,196.72	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	122.29	1,085,323.75	
CME GROUP INC	29,373	174.27	5,118,832.71	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	49.42	473,245.92	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,002	101.90	2,140,103.80	
EQUITABLE HOLDINGS INC	34,355	29.63	1,017,938.65	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	421.45	1,326,724.60	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	29.34	764,893.80	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	51.68	223,050.88	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,241	350.75	9,554,780.75	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,833	106.92	4,686,624.36	
INVESCO LTD	26,420	18.58	490,883.60	
KKR & CO INC	44,282	50.50	2,236,241.00	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	220.44	1,407,729.84	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	327.13	1,049,105.91	
MOODY'S CORP	13,365	312.96	4,182,710.40	
MORGAN STANLEY	102,856	94.15	9,683,892.40	
MSCI INC	6,518	495.79	3,231,559.22	
NASDAQ INC	28,971	61.00	1,767,231.00	
NORTHERN TRUST CORP	15,902	90.46	1,438,494.92	
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	114.00	2,041,398.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	112.44	1,741,245.84	
S&P GLOBAL INC	27,238	361.13	9,836,458.94	
SCHWAB (CHARLES) CORP	116,338	76.32	8,878,916.16	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	60.82	580,831.00	

STATE STREET CORP	30,359	80.52	2,444,506.68	
SYNCHRONY FINANCIAL	41,566	32.58	1,354,220.28	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	71.15	644,690.15	
AFLAC	46,816	70.68	3,308,954.88	
ALLSTATE CORP	22,174	124.64	2,763,767.36	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	137.31	867,661.89	
AMERICAN INT'L GROUP	62,635	61.72	3,865,832.20	
AON PLC	16,687	318.96	5,322,485.52	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	63.39	1,884,331.14	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,431	190.89	3,327,403.59	
ASSURANT INC	4,726	125.86	594,814.36	
BROWN & BROWN INC	19,873	60.25	1,197,348.25	
CHUBB LTD	33,210	219.25	7,281,292.50	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	101.15	1,293,809.65	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	243.07	526,489.62	
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	344.49	1,132,683.12	
FNF GROUP	20,461	41.23	843,607.03	
GLOBE LIFE INC	8,106	117.32	950,995.92	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	74.31	1,837,760.61	
LINCOLN NATIONAL CORP	13,484	29.93	403,576.12	
LOEWS CORP	16,741	58.07	972,149.87	
MARKEL CORP	1,156	1,371.73	1,585,719.88	
MARSH & MCLENNAN COS	39,396	169.60	6,681,561.60	
METLIFE INC	54,127	69.43	3,758,037.61	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20,719	86.91	1,800,688.29	
PROGRESSIVE CORP	47,167	125.92	5,939,268.64	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,146	96.94	3,019,293.24	
TRAVELERS COS INC/THE	18,521	184.04	3,408,604.84	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,448	251.72	2,126,530.56	
WR BERKLEY CORP	17,572	69.80	1,226,525.60	
CBRE GROUP INC-A	25,904	83.39	2,160,134.56	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.75	468,825.00	
WEYERHAEUSER CO	59,710	31.10	1,856,981.00	
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	41.81	561,382.87	
ACCENTURE PLC-CL A	50,787	272.89	13,859,264.43	
ADOBE INC	37,482	342.53	12,838,709.46	
AFFIRM HOLDINGS INC	12,816	12.25	156,996.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	13,673	86.59	1,183,945.07	
ANSYS INC	6,794	248.40	1,687,629.60	
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	193.77	463,885.38	
AUTODESK INC	17,467	196.05	3,424,405.35	
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,866	233.32	7,668,295.12	

BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	37.10	519,251.60	
BILL.COM HOLDINGS INC	7,443	99.72	742,215.96	
BLACK KNIGHT INC	11,543	58.28	672,726.04	
BLOCK INC	41,057	70.94	2,912,583.58	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	142.34	1,386,676.28	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,364	171.95	3,673,539.80	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	67.25	717,423.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	131.84	1,071,068.16	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	42.70	866,084.10	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	39,936	61.37	2,450,872.32	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,831	99.85	1,680,575.35	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	124.17	384,927.00	
DATADOG INC - CLASS A	20,137	67.43	1,357,837.91	
DOCUSIGN INC	14,969	53.99	808,176.31	
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	22.53	519,722.04	
DYNATRACE INC	14,790	36.02	532,735.80	
EPAM SYSTEMS INC	4,779	336.00	1,605,744.00	
FAIR ISAAC CORP	2,125	623.86	1,325,702.50	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	49,912	71.03	3,545,249.36	
FISERV INC	47,748	102.18	4,878,890.64	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	192.59	1,155,925.18	
FORTINET INC	51,829	48.42	2,509,560.18	
GARTNER INC	6,340	324.47	2,057,139.80	
GEN DIGITAL INC	52,157	21.94	1,144,324.58	
GLOBAL PAYMENTS INC	22,567	108.64	2,451,678.88	
GODADDY INC - CLASS A	13,798	77.95	1,075,554.10	
HUBSPOT INC	3,646	311.82	1,136,895.72	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,616	140.62	10,070,641.92	
INTUIT INC	21,209	378.60	8,029,727.40	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	176.84	1,112,500.44	
MASTERCARD INC-CLASS A	68,745	367.94	25,294,035.30	
MICROSOFT CORP	566,793	231.93	131,456,300.49	
MONGODB INC	5,325	189.31	1,008,075.75	
OKTA INC	11,505	67.67	778,543.35	
ORACLE CORP	127,935	85.94	10,994,733.90	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	6.73	842,892.12	
PALO ALTO NETWORKS INC	24,237	140.71	3,410,388.27	
PAYCHEX INC	26,693	115.52	3,083,575.36	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	304.80	1,290,828.00	
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	195.63	669,641.49	
PAYPAL HOLDINGS INC	86,747	76.75	6,657,832.25	
PTC INC	8,226	127.57	1,049,390.82	

ROPER TECHNOLOGIES INC	8,672	432.18	3,747,864.96	
SALESFORCE INC	80,093	146.41	11,726,416.13	
SERVICENOW INC	16,202	428.43	6,941,422.86	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,680	135.24	2,391,043.20	
SPLUNK INC	13,355	87.55	1,169,230.25	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	55.59	1,074,832.65	
SYNOPSYS INC	12,539	331.28	4,153,919.92	
TOAST INC-CLASS A	20,341	19.28	392,174.48	
TWILIO INC - A	12,842	52.10	669,068.20	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	305.34	1,019,530.26	
UNITY SOFTWARE INC	21,912	28.90	633,256.80	
VERISIGN INC	7,790	211.64	1,648,675.60	
VISA INC-CLASS A SHARES	130,324	220.41	28,724,712.84	
VMWARE INC-CLASS A	16,717	122.94	2,055,187.98	
WESTERN UNION CO	29,297	13.94	408,400.18	
WIX.COM LTD	5,010	81.88	410,218.80	
WORKDAY INC-CLASS A	16,567	167.54	2,775,635.18	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19,002	66.83	1,269,998.67	
ZSCALER INC	7,204	110.37	795,105.48	
AMPHENOL CORPORATION	47,254	77.38	3,656,514.52	
APPLE INC	1,285,830	135.27	173,934,224.10	
ARISTA NETWORKS INC	20,350	111.51	2,269,228.50	
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	113.32	491,582.16	
CDW CORP/DE	10,882	197.29	2,146,909.78	
CISCO SYSTEMS	332,924	46.46	15,467,649.04	
COGNEX CORP	14,352	50.63	726,641.76	
CORNING	64,989	35.75	2,323,356.75	
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	39.46	887,100.26	
F5 INC	4,851	140.95	683,748.45	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,530	15.81	1,731,669.30	
HP INC	83,910	26.96	2,262,213.60	
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	31.45	796,345.45	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	176.72	2,445,451.36	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,014	252.53	3,286,425.42	
NETAPP INC	18,303	64.51	1,180,726.53	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	58.19	964,964.77	
TE CONNECTIVITY LTD	26,068	121.34	3,163,091.12	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	400.83	1,562,836.17	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	54.20	1,147,739.20	
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	37.55	968,414.50	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	287.72	1,197,490.64	
AT&T INC	569,160	18.94	10,779,890.40	

LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	20.81	322,887.96	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	27,487	21.58	593,169.46	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	73,769	5.03	371,058.07	
T-MOBILE US INC	49,791	145.14	7,226,665.74	
VERIZON COMMUNICATIONS	337,746	40.06	13,530,104.76	
AES CORP	54,375	26.64	1,448,550.00	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	53.21	1,105,597.38	
AMEREN CORPORATION	20,898	86.04	1,798,063.92	
AMERICAN ELECTRIC POWER	39,907	91.63	3,656,678.41	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,165	150.19	2,277,631.35	
ATMOS ENERGY CORP	11,302	112.04	1,266,276.08	
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	30.28	1,437,270.48	
CMS ENERGY CORP	23,697	61.10	1,447,886.70	
CONSOLIDATED EDISON INC	29,197	92.48	2,700,138.56	
CONSTELLATION ENERGY	25,114	80.84	2,030,215.76	
DOMINION ENERGY INC	66,179	62.01	4,103,759.79	
DTE ENERGY COMPANY	15,851	112.56	1,784,188.56	
DUKE ENERGY CORP	60,751	101.97	6,194,779.47	
EDISON INTL	30,339	65.67	1,992,362.13	
ENTERGY CORP	16,181	107.00	1,731,367.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	46.50	948,553.50	
EVERGY INC	18,475	59.25	1,094,643.75	
EVERSOURCE ENERGY	28,450	79.78	2,269,741.00	
EXELON CORP	81,218	42.04	3,414,404.72	
FIRSTENERGY CORP	45,165	41.90	1,892,413.50	
NEXTERA ENERGY INC	158,046	82.59	13,053,019.14	
NISOURCE INC	32,351	26.83	867,977.33	
NRG ENERGY INC	19,068	31.03	591,680.04	
PG&E CORP	118,132	15.44	1,823,958.08	
PPL CORPORATION	58,459	29.15	1,704,079.85	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	60.02	2,368,869.36	
SEMPRA ENERGY	24,582	155.78	3,829,383.96	
SOUTHERN CO	85,837	66.45	5,703,868.65	
UGI CORP	18,019	38.90	700,939.10	
VISTRA CORP	31,797	21.39	680,137.83	
WEC ENERGY GROUP INC	26,033	91.80	2,389,829.40	
XCEL ENERGY INC	43,741	68.00	2,974,388.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	127,756	67.71	8,650,358.76	
ANALOG DEVICES	41,391	163.13	6,752,113.83	
APPLIED MATERIALS	68,040	106.16	7,223,126.40	
BROADCOM INC	32,135	563.22	18,099,074.70	
ENPHASE ENERGY INC	11,020	222.97	2,457,129.40	

	ENTEGRIS INC	12,483	75.54	942,965.82	
	FIRST SOLAR INC	7,921	165.01	1,307,044.21	
	INTEL CORP	325,216	28.42	9,242,638.72	
	KLA CORP	11,591	402.10	4,660,741.10	
	LAM RESEARCH CORP	10,752	453.89	4,880,225.28	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,444	38.57	2,717,025.08	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	71.75	3,177,735.75	
	MICRON TECHNOLOGY	86,632	56.36	4,882,579.52	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	383.29	1,353,396.99	
	NVIDIA CORP	198,506	167.65	33,279,530.90	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,458	165.00	3,375,570.00	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	63.49	2,188,373.32	
	QORVO INC	8,556	98.79	845,247.24	
	QUALCOMM	89,829	117.58	10,562,093.82	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	99.92	1,336,130.24	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,156	286.72	1,191,608.32	
	TERADYNE INC	12,318	93.85	1,156,044.30	
	TEXAS INSTRUMENTS	72,551	170.93	12,401,142.43	
	WOLFSPEED INC	10,256	76.31	782,635.36	
アメリカドル 小計		27,362,121		2,692,470,843.52 (346,547,922,269)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	16.60	910,676.00	
	CAMECO CORP	31,793	34.09	1,083,823.37	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	91,162	80.07	7,299,341.34	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	25.38	2,824,616.34	
	ENBRIDGE	159,030	55.74	8,864,332.20	
	IMPERIAL OIL	20,285	68.34	1,386,276.90	
	KEYERA CORP	18,607	31.17	579,980.19	
	PARKLAND CORP	14,075	31.09	437,591.75	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	48.36	2,208,407.76	
	SUNCOR ENERGY	109,226	44.59	4,870,387.34	
	TC ENERGY CORP	78,423	57.91	4,541,475.93	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	67.82	1,696,110.38	
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	74.76	2,717,825.04	
	BARRICK GOLD CORP	133,727	25.22	3,372,594.94	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	60.00	788,340.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	51,836	29.94	1,551,969.84	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	196.96	3,025,896.48	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	12.11	627,867.17	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	6.31	684,325.81	
	LUNDIN MINING CORP	62,243	9.37	583,216.91	
	NUTRIEN LTD	41,509	102.68	4,262,144.12	

PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	25.03	460,827.33	
TECK RESOURCES LTD-CL B	40,179	56.07	2,252,836.53	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6,100	96.80	590,480.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	32,518	60.54	1,968,639.72	
CAE INC	25,999	28.28	735,251.72	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,585	101.63	770,863.55	
WSP GLOBAL INC	9,951	172.21	1,713,661.71	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	40.88	552,084.40	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	80.28	822,468.60	
THOMSON REUTERS CORP	13,293	157.58	2,094,710.94	
AIR CANADA	13,805	21.56	297,635.80	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	46,034	163.80	7,540,369.20	
CP RAILWAY LIMITED	72,867	104.81	7,637,190.27	
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	142.62	832,472.94	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	84.99	1,978,737.18	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	105.22	323,025.40	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	41.43	707,582.97	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	88.22	2,035,500.06	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	30.06	456,912.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	34,180	38.40	1,312,512.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	155.84	703,305.92	
DOLLARAMA INC	22,000	81.40	1,790,800.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,467	62.93	4,245,698.31	
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	36.52	557,039.56	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	117.74	1,520,376.62	
METRO INC	18,840	74.52	1,403,956.80	
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	171.78	897,722.28	
SAPUTO INC	20,898	36.02	752,745.96	
BANK MONTREAL	52,473	131.36	6,892,853.28	
BANK NOVA SCOTIA	93,348	68.96	6,437,278.08	
CANADIAN IMPERIAL BANK	69,593	57.98	4,035,002.14	
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	97.33	2,656,038.37	
ROYAL BANK OF CANADA	111,488	134.47	14,991,791.36	
TORONTO-DOMINION BANK	145,422	88.57	12,880,026.54	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	42.25	1,225,292.25	
BROOKFIELD CORP	108,921	48.01	5,229,297.21	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	19.50	635,290.50	
IGM FINANCIAL INC	7,685	40.51	311,319.35	
ONEX CORP	6,603	66.70	440,420.10	
TMX GROUP LTD	4,685	135.20	633,412.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	798.11	1,399,884.94	
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	34.02	809,267.76	

	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	80.80	815,999.20	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,255	196.91	2,610,042.05	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	154,778	25.13	3,889,571.14	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	35.04	1,526,938.08	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	44,467	64.65	2,874,791.55	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	182.13	489,929.70	
	CGI INC - CL A	18,300	116.23	2,127,009.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	2,275.11	3,649,276.44	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	94.91	662,851.44	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	42.46	182,620.46	
	OPEN TEXT CORP	20,463	43.85	897,302.55	
	SHOPIFY INC - CLASS A	91,833	51.29	4,710,114.57	
	BCE INC	6,203	62.16	385,578.48	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,196	64.77	1,955,794.92	
	TELUS CORP	32,908	28.23	928,992.84	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	9.41	487,607.38	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	24.21	590,602.95	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	41.78	471,905.10	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	37.79	390,143.96	
	EMERA INC	23,223	54.10	1,256,364.30	
	FORTIS INC	40,183	55.89	2,245,827.87	
	HYDRO ONE LTD	28,888	37.35	1,078,966.80	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	38.31	683,986.74	
カナダドル 小計		3,277,488		194,761,998.98 (18,615,351,862)	
ユーロ	ENI	198,271	14.25	2,826,154.83	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	12.56	498,154.72	
	NESTE OIL OYJ	36,735	44.53	1,635,809.55	
	OMV AG	12,549	45.50	570,979.50	
	REPSOL SA	111,112	15.14	1,682,235.68	
	TENARIS SA	40,648	16.35	664,594.80	
	TOTALENERGIES SE	199,624	58.34	11,646,064.16	
	AIR LIQUIDE	41,239	144.80	5,971,407.20	
	AKZO NOBEL	15,301	66.92	1,023,942.92	
	ARCELORMITTAL	41,072	27.89	1,145,703.44	
	ARKEMA	4,369	91.42	399,413.98	
	BASF SE	73,837	52.18	3,852,814.66	
	COVESTRO AG	14,454	40.71	588,422.34	
	CRH PLC	60,480	41.14	2,488,449.60	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	19.73	316,410.01	
	HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	58.50	762,898.50	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,707	122.10	1,673,624.70	

OCI NV	7,248	32.50	235,560.00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	38.82	757,145.28	
SOLVAY SA	5,356	102.50	548,990.00	
STORA ENSO OYJ R	42,169	13.81	582,564.73	
SYMRISE AG	10,018	104.60	1,047,882.80	
UMICORE	17,605	33.72	593,640.60	
UPM KYMMENE OYJ	42,324	33.14	1,402,617.36	
VOESTALPINE AG	7,152	28.46	203,545.92	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	15,358	28.05	430,791.90	
AIRBUS SE	46,560	116.92	5,443,795.20	
ALSTOM	24,388	25.45	620,674.60	
BOUYGUES ORD	16,606	29.52	490,209.12	
BRENNTAG SE	12,514	66.36	830,429.04	
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	15.48	1,254,687.61	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,584	29.10	1,151,894.40	
DASSAULT AVIATION SA	2,130	159.00	338,670.00	
EIFFAGE	5,924	97.16	575,575.84	
FERROVIAL SA	37,026	26.39	977,116.14	
GEA GROUP AG	13,382	40.37	540,231.34	
IMCD NV	4,641	146.00	677,586.00	
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	56.74	703,462.52	
KNORR-BREMSE AG	5,022	57.04	286,454.88	
KONE OYJ-B	26,369	51.04	1,345,873.76	
LEGRAND SA	21,768	80.56	1,753,630.08	
MTU AERO ENGINES AG	3,962	225.00	891,450.00	
PRYSMIAN SPA	21,155	36.26	767,080.30	
RATIONAL AG	483	623.00	300,909.00	
RHEINMETALL AG	3,660	223.20	816,912.00	
SAFRAN SA	26,468	127.22	3,367,258.96	
SAINT-GOBAIN	40,093	53.08	2,128,136.44	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,646	142.98	6,097,525.08	
SIEMENS	60,788	140.60	8,546,792.80	
SIEMENS ENERGY AG	36,841	18.74	690,400.34	
THALES SA	8,524	118.00	1,005,832.00	
VINCI S.A.	43,377	102.38	4,440,937.26	
WARTSILA OYJ	41,917	8.58	359,899.36	
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.17	656,160.41	
RANDSTAD NV	10,558	59.10	623,977.80	
TELEPERFORMANCE	4,734	250.00	1,183,500.00	
WOLTERS KLUWER	20,644	100.60	2,076,786.40	
ADP	2,382	139.25	331,693.50	
AENA SME SA	5,508	134.85	742,753.80	

DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	9.35	423,957.05	
DEUTSCHE POST AG-REG	76,659	39.33	3,014,998.47	
GETLINK	35,220	15.39	542,211.90	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,705	90.02	2,403,984.10	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	84.95	423,985.45	
CONTINENTAL AG	8,168	62.60	511,316.80	
DR ING HC F PORSCHE AG	9,400	104.20	979,480.00	
FERRARI NV	10,170	219.40	2,231,298.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	62,534	65.52	4,097,227.68	
MICHELIN	55,356	28.86	1,597,574.16	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	54.26	637,283.70	
RENAULT SA	17,362	36.50	633,713.00	
STELLANTIS NV	175,794	13.91	2,445,294.54	
VALEO SA	16,596	18.90	313,664.40	
VOLKSWAGEN AG-PFD	14,083	123.14	1,734,180.62	
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	157.15	390,674.90	
ADIDAS AG	13,972	144.14	2,013,924.08	
HERMES INTERNATIONAL	2,516	1,614.50	4,062,082.00	
KERING	5,787	530.00	3,067,110.00	
LVMH	22,241	776.60	17,272,360.60	
MONCLER SPA	14,541	55.02	800,045.82	
PUMA SE	9,220	61.54	567,398.80	
SEB SA	2,282	90.35	206,178.70	
ACCOR	14,436	28.88	416,911.68	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,563	140.75	1,768,242.25	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	39.84	323,022.72	
SODEXO	8,122	90.64	736,178.08	
BOLLORE SE	83,646	5.28	442,069.11	
PUBLICIS GROUPE	20,082	61.82	1,241,469.24	
SCOUT24 SE	7,492	50.04	374,899.68	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	19.23	135,975.33	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	61,243	22.88	1,401,239.84	
VIVENDI SE	61,243	9.46	579,481.26	
D'IETEREN GROUP	2,217	172.70	382,875.90	
DELIVERY HERO SE	13,414	49.98	670,431.72	
INDITEX	87,326	26.90	2,349,069.40	
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	24.03	374,195.16	
PROSUS	64,875	74.36	4,824,105.00	
ZALANDO SE	17,664	40.95	723,340.80	
CARREFOUR	52,544	17.04	895,612.48	
HELLOFRESH SE	13,805	22.93	316,548.65	
JERONIMO MARTINS	24,901	19.84	494,035.84	

KESKO OYJ-B SHS	20,083	20.81	417,927.23	
KONINKLIJKE AHOLD NV	86,170	27.84	2,399,403.65	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	67,606	55.05	3,721,710.30	
DANONE (GROUPE)	51,543	50.21	2,587,974.03	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	9.84	483,310.29	
HEINEKEN HOLDING NV	9,251	74.15	685,961.65	
HEINEKEN NV	20,157	90.84	1,831,061.88	
JDE PEET'S BV	7,000	27.68	193,760.00	
KERRY GROUP PLC-A	13,050	87.68	1,144,224.00	
PERNOD-RICARD	16,694	192.30	3,210,256.20	
REMY COINTREAU	1,382	172.20	237,980.40	
BEIERSDORF AG	7,430	111.15	825,844.50	
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	61.25	537,775.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	66.14	954,995.46	
LOREAL	19,143	376.60	7,209,253.80	
AMPLIFON SPA	11,650	26.43	307,909.50	
BIOMERIEUX	3,044	97.20	295,876.80	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	131.65	451,559.50	
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	127.35	263,614.50	
ESSILORLUXOTTICA	22,662	170.95	3,874,068.90	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	33.22	564,241.70	
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	28.00	943,292.00	
KONINKLIJKE PHILIPS	71,755	14.94	1,072,450.23	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	48.34	1,042,548.78	
ARGENX SE	4,713	354.20	1,669,344.60	
BAYER	76,626	55.72	4,269,600.72	
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	64.34	657,554.80	
GRIFOLS SA	27,685	12.06	333,881.10	
IPSEN	3,532	103.50	365,562.00	
MERCK KGAA	10,555	189.00	1,994,895.00	
ORION OYJ-CLASS B	9,854	49.54	488,167.16	
QIAGEN N.V.	17,038	46.09	785,281.42	
RECORDATI SPA	9,859	41.63	410,430.17	
SANOFI	90,096	91.25	8,221,260.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	396.80	723,763.20	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,539	310.10	787,343.90	
UCB (GROUPE)	9,389	77.46	727,271.94	
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	14.28	570,271.48	
AIB GROUP PLC	88,299	3.68	325,116.91	
BANCO BILBAO VIZCAYA	500,450	6.31	3,157,839.50	
BANCO SANTANDER SA	1,306,699	3.04	3,982,165.20	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.04	799,644.14	

BNP PARIBAS	89,599	58.90	5,277,381.10	
CAIXABANK	326,789	3.86	1,261,732.32	
COMMERZBANK AG	81,889	9.52	779,910.83	
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	10.43	1,037,692.60	
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	32.64	828,272.64	
FINECOBANK SPA	53,120	16.23	862,403.20	
ING GROEP NV-CVA	308,335	12.16	3,751,203.61	
INTESA SANPAOLO	1,322,943	2.22	2,940,902.28	
KBC GROEP NV	18,281	66.44	1,214,589.64	
MEDIOBANCA	53,990	9.43	509,449.64	
SOCIETE GENERALE	63,329	24.21	1,533,511.73	
UNICREDIT SPA	149,896	14.62	2,191,479.52	
AMUNDI SA	4,626	59.50	275,247.00	
DEUTSCHE BANK NAMEN	157,109	11.75	1,846,659.18	
DEUTSCHE BOERSE	14,594	165.95	2,421,874.30	
EURAZEO SA	3,357	63.65	213,673.05	
EURONEXT NV	6,480	74.90	485,352.00	
EXOR NV	7,825	71.46	559,174.50	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	77.94	663,659.10	
SOFINA	1,238	209.20	258,989.60	
WENDEL	2,023	95.20	192,589.60	
AEGON	148,741	4.91	731,656.97	
AGEAS	11,086	43.77	485,234.22	
ALLIANZ SE-REG	32,633	217.10	7,084,624.30	
ASSICURAZIONI GENERALI	82,625	17.37	1,435,196.25	
AXA SA	145,657	27.88	4,060,917.16	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,399	187.80	1,013,932.20	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,181	326.60	3,651,714.60	
NN GROUP NV	22,611	38.70	875,045.70	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.55	439,726.32	
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	48.54	1,876,313.70	
AROUNDTOWN SA	64,068	2.67	171,638.17	
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	71.94	379,483.50	
VONOVIA SE	59,080	26.15	1,544,942.00	
ADYEN NV	1,746	1,303.20	2,275,387.20	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,321	55.78	1,970,205.38	
BECHTLE AG	7,659	36.06	276,183.54	
CAPGEMINI SA	12,468	172.00	2,144,496.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	34.83	1,838,138.44	
EDENRED	20,131	50.32	1,012,991.92	
NEMETSCHEK SE	5,455	49.72	271,222.60	
NEXI SPA	48,458	8.02	388,923.90	

	SAP SE	82,544	106.50	8,790,936.00	
	WORLDLINE SA	20,332	39.63	805,757.16	
	NOKIA OYJ	409,217	4.38	1,793,802.71	
	CELLNEX TELECOM SA	46,824	33.23	1,555,961.52	
	DEUTSCHE TELEKOM	256,698	20.18	5,181,449.13	
	ELISA A	10,227	51.36	525,258.72	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.90	300,712.50	
	KPN (KON.)	282,927	3.00	851,044.41	
	ORANGE	149,082	9.57	1,427,161.98	
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.25	217,144.99	
	TELEFONICA	431,420	3.52	1,519,461.24	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.52	249,057.94	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	21.96	208,905.48	
	ACCIONA SA	2,181	186.80	407,410.80	
	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	38.30	208,237.10	
	E.ON SE	165,549	9.86	1,633,306.43	
	EDP RENOVAVEIS SA	21,466	20.41	438,121.06	
	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	12.00	474,252.00	
	ELIA GROUP SA/NV	3,125	136.10	425,312.50	
	ENAGAS	21,663	16.67	361,122.21	
	ENDESA	25,972	18.30	475,417.46	
	ENEL	630,812	5.65	3,568,503.48	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.73	1,068,714.70	
	ENGIE	145,658	12.47	1,816,646.57	
	FORTUM OYJ	32,550	14.16	460,908.00	
	IBERDROLA SA	478,499	10.80	5,170,181.69	
	IBERDROLA SA-RIGHTS	478,499	0.18	89,957.81	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.00	260,260.00	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	16.60	509,408.19	
	RWE STAMM	50,344	40.93	2,060,579.92	
	SNAM SPA	147,559	4.90	723,039.10	
	TERNA SPA	122,810	7.29	895,776.14	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,273	26.48	1,304,749.04	
	VERBUND AG	6,430	76.50	491,895.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,995	295.90	1,182,120.50	
	ASML HOLDING NV	32,300	590.60	19,076,380.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES	105,329	31.35	3,302,064.15	
	STMICROELECTRONICS	55,076	38.04	2,095,366.42	
ユーロ 小計		15,169,585		364,874,263.17 (50,852,526,058)	
イギリスポンド	BP PLC	1,484,181	4.74	7,045,407.20	
	SHELL PLC-NEW	576,687	23.60	13,612,696.63	

ANGLO AMERICAN PLC	101,345	35.63	3,611,429.07	
ANTOFAGASTA PLC	29,856	17.23	514,418.88	
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	69.32	757,251.68	
GLENCORE PLC	797,868	5.64	4,500,773.38	
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	21.40	360,547.20	
MONDI PLC	41,710	14.82	618,142.20	
RIO TINTO PLC REG	88,610	61.51	5,450,401.10	
ASHTEAD GROUP PLC	33,317	49.30	1,642,528.10	
BAE SYSTEMS PLC	260,104	8.43	2,193,717.13	
BUNZL PLC	23,700	29.17	691,329.00	
DCC PLC	6,622	44.51	294,745.22	
MELROSE INDUSTRIES PLC	369,777	1.45	538,949.97	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.05	668,213.17	
SMITHS GROUP PLC	26,476	17.07	452,077.70	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	114.15	629,423.10	
EXPERIAN PLC	74,115	29.62	2,195,286.30	
INTERTEK GROUP PLC	13,890	42.93	596,297.70	
RELX PLC	149,499	23.77	3,553,591.23	
RENTOKIL INITIAL PLC	212,480	5.03	1,069,624.32	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.45	326,114.91	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	10,688	41.89	447,720.32	
BURBERRY GROUP PLC	29,776	23.03	685,741.28	
PERSIMMON PLC	25,686	13.79	354,209.94	
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.13	298,569.57	
COMPASS GROUP PLC	142,427	18.98	2,703,264.46	
ENTAIN PLC	49,630	14.82	735,516.60	
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	55.60	823,491.60	
WHITBREAD PLC	17,434	29.62	516,395.08	
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.72	414,917.41	
INFORMA PLC	110,598	6.60	730,389.19	
PEARSON	55,305	9.42	521,083.71	
WPP PLC	85,821	9.15	785,777.07	
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.52	315,925.18	
KINGFISHER PLC	153,717	2.58	397,973.31	
NEXT PLC	11,468	64.02	734,181.36	
OCADO GROUP PLC	54,753	7.07	387,541.73	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.41	357,635.68	
TESCO PLC	601,050	2.48	1,491,806.10	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	18.14	466,923.60	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	169,799	31.08	5,277,352.92	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	19.29	346,448.40	
DIAGEO	179,481	36.92	6,626,438.52	

	IMPERIAL BRANDS PLC	76,080	20.51	1,560,400.80	
	HALEON PLC	405,046	3.13	1,269,009.11	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,052	58.40	3,273,436.80	
	UNILEVER PLC	204,465	40.91	8,365,685.47	
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.31	775,809.45	
	ASTRAZENECA	124,743	114.20	14,245,650.60	
	GSK PLC	318,698	14.18	4,521,049.82	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	16.99	279,553.46	
	BARCLAYS	1,339,545	1.77	2,376,084.92	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,595,458	5.85	9,341,406.59	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,254,644	0.48	2,564,529.00	
	NATWEST GROUP PLC	412,008	2.92	1,206,359.42	
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	6.95	1,477,349.48	
	3I GROUP PLC	74,757	14.15	1,058,185.33	
	ABRDN PLC	153,430	2.01	308,394.30	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.87	293,543.04	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	26,297	74.98	1,971,749.06	
	M&G PLC	229,107	2.01	462,567.03	
	SCHRODERS PLC	49,376	4.66	230,437.79	
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	12.29	503,283.53	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	21.16	343,955.80	
	AVIVA PLC	240,378	4.36	1,048,528.83	
	LEGAL & GENERAL GROUP	490,759	2.53	1,242,601.78	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.21	316,920.21	
	PRUDENTIAL	212,226	12.83	2,722,859.58	
	SAGE GROUP PLC	76,660	7.53	577,403.12	
	HALMA PLC	31,069	21.08	654,934.52	
	BT GROUP PLC	607,358	1.27	772,255.69	
	VODAFONE GROUP PLC	2,204,746	0.90	1,990,003.73	
	NATIONAL GRID PLC	302,035	10.35	3,126,062.25	
	SEVERN TRENT PLC	22,468	28.02	629,553.36	
	SSE PLC	90,604	17.02	1,542,080.08	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.40	526,284.90	
イギリスポンド 小計		22,567,857		148,320,197.07 (23,643,722,614)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	15.41	268,103.18	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	659.50	378,553.00	
	GIVAUDAN-REG	748	2,951.00	2,207,348.00	
	HOLCIM LTD	44,847	51.82	2,323,971.54	
	SIG GROUP AG	26,203	22.46	588,519.38	
	SIKA AG-BR	11,714	256.30	3,002,298.20	
	ABB LTD	122,184	30.68	3,748,605.12	

	GEBERIT AG-REG	2,964	489.70	1,451,470.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	182.00	372,736.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	192.55	595,364.60	
	VAT GROUP AG	1,956	279.80	547,288.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	16,208	32.99	534,701.92	
	SGS SA	506	2,304.00	1,165,824.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	217.10	993,666.70	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,941	135.05	5,529,082.05	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	296.60	736,457.80	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	54.60	215,014.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,920.00	537,600.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	99,300.00	794,400.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,950.00	815,900.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	220,071	112.32	24,718,374.72	
	ALCON INC	38,399	68.08	2,614,203.92	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,686	232.30	1,088,557.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	120.60	1,029,924.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	82.30	152,255.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,733	489.60	2,806,876.80	
	NOVARTIS	171,758	84.51	14,515,268.58	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	350.60	776,579.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,824	294.45	16,437,376.80	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	87.05	216,493.35	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	297,417	2.98	886,897.49	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	57.46	1,085,821.62	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	851.20	1,560,249.60	
	UBS GROUP AG	261,888	19.15	5,015,155.20	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,968	147.60	438,076.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	524.40	1,268,523.60	
	SWISS RE LTD	24,445	92.98	2,272,896.10	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,854	439.80	5,213,389.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	82.20	466,813.80	
	TEMENOS AG - REG	5,150	61.04	314,356.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	50.94	748,104.84	
	SWISSCOM	2,187	533.80	1,167,420.60	
	BKW AG	1,744	132.30	230,731.20	
スイスフラン 小計		1,465,481		111,831,251.91 (15,708,935,955)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	22,252	445.80	9,919,941.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	10,000	428.80	4,288,000.00	
	SCA SV CELLULOSA B	53,887	143.80	7,748,950.60	
	ALFA LAVAL AB	19,283	318.60	6,143,563.80	

	ASSA ABLOY AB-B	84,158	241.40	20,315,741.20	
	ATLAS COPCO A	207,097	129.20	26,756,932.40	
	ATLAS COPCO B	127,608	114.10	14,560,072.80	
	EPIROC AB-A	53,479	207.00	11,070,153.00	
	EPIROC AB-B	28,804	177.75	5,119,911.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	77.98	3,018,761.76	
	INDUTRADE AB	22,644	225.00	5,094,900.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	211.30	2,958,622.60	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	187.20	3,363,984.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	102.55	12,598,062.40	
	SANDVIK AB	87,644	204.90	17,958,255.60	
	SKANSKA B	25,507	180.25	4,597,636.75	
	SKF AB-B	25,671	178.65	4,586,124.15	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	208.40	2,816,317.60	
	VOLVO B	126,238	198.42	25,048,143.96	
	SECURITAS B	49,533	93.96	4,654,120.68	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	48.00	2,392,272.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	150.00	3,190,350.00	
	EVOLUTION AB	15,096	1,151.80	17,387,572.80	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	44.47	2,363,447.09	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	125.34	6,922,402.86	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	285.60	14,129,774.40	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	221.70	3,945,373.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	228.40	3,274,114.00	
	NORDEA BANK ABP	258,570	117.96	30,500,917.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	123.55	16,215,319.75	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	108.05	13,045,524.80	
	SWEDBANK AB-A	72,526	187.65	13,609,503.90	
	EQT AB	23,207	222.50	5,163,557.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	269.30	3,182,587.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	268.70	3,000,841.60	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	202.90	7,897,882.50	
	INVESTOR AB-B SHS	150,321	200.95	30,207,004.95	
	KINNEVIK AB - B	18,792	156.70	2,944,706.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	470.30	3,423,784.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	55.54	3,149,118.00	
	SAGAX AB-B	17,402	254.70	4,432,289.40	
	ERICSSON (LM) B	214,689	61.91	13,291,395.99	
	HEXAGON AB-B SHS	163,838	116.20	19,037,975.60	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	92.72	4,335,772.64	
	TELIA CO AB	230,643	27.67	6,381,891.81	
		3,001,658		426,043,575.69	

スウェーデンクローナ 小計				(5,308,502,953)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	27,755	306.00	8,493,030.00	
	EQUINOR ASA	73,436	303.40	22,280,482.40	
	NORSK HYDRO	124,309	79.88	9,929,802.92	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	446.70	5,582,856.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	392.80	3,395,756.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	81.10	1,550,388.70	
	MOWI ASA	31,968	176.40	5,639,155.20	
	ORKLA	69,804	72.88	5,087,315.52	
	SALMAR ASA	5,423	417.80	2,265,729.40	
	DNB BANK ASA	71,795	182.45	13,098,997.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	186.10	3,456,621.40	
	TELENOR ASA	51,193	104.05	5,326,631.65	
ノルウェークローネ 小計		514,517		86,106,767.54 (1,118,526,910)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	497.20	4,217,747.60	
	NOVOZYMES A/S	17,111	347.30	5,942,650.30	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,868.50	1,410,717.50	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	81,654	201.15	16,424,702.10	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	14,360.00	3,144,840.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	14,680.00	6,371,120.00	
	DSV A/S	15,307	1,123.50	17,197,414.50	
	PANDORA A/S	8,163	552.80	4,512,506.40	
	CARLSBERG AS-B	6,830	980.00	6,693,400.00	
	COLOPLAST-B	9,208	851.20	7,837,849.60	
	DEMANT A/S	8,512	196.00	1,668,352.00	
	GENMAB A/S	5,250	2,708.00	14,217,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,530	958.10	126,018,893.00	
	DANSKE BANK A/S	56,132	139.85	7,850,060.20	
	TRYG A/S	29,772	161.50	4,808,178.00	
	ORSTED A/S	15,439	666.50	10,290,093.50	
デンマーククローネ 小計		394,799		238,605,524.70 (4,469,081,477)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	29.60	610,618.40	
	SANTOS	265,406	7.24	1,921,539.44	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	23,456	28.58	670,372.48	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	147,086	36.78	5,409,823.08	
	BHP GROUP LTD	406,499	49.68	20,194,870.32	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	18.81	654,023.70	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	22.58	3,129,407.36	
	IGO LTD	56,345	14.34	807,987.30	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	29.70	1,097,355.60	

	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	88.06	1,268,856.54	
	NEWCREST MINING LIMITED	73,939	22.54	1,666,585.06	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	12.16	1,235,796.48	
	ORICA LTD	38,288	15.08	577,383.04	
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.02	842,129.70	
	RIO TINTO LTD	28,272	125.96	3,561,141.12	
	SOUTH32 LTD	407,531	4.56	1,858,341.36	
	REECE LTD	16,814	15.64	262,970.96	
	BRAMBLES LTD	108,007	11.73	1,266,922.11	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.74	447,270.34	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.54	555,900.00	
	TRANSURBAN GROUP	249,674	13.74	3,430,520.76	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	33.48	1,547,110.80	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	30.10	535,569.30	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.83	879,122.79	
	REA GROUP LTD	3,586	123.57	443,122.02	
	SEEK LTD	28,001	24.16	676,504.16	
	WESFARMERS LTD	91,917	49.32	4,533,346.44	
	COLES GROUP LTD	108,486	17.19	1,864,874.34	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.47	711,059.47	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,901	34.93	3,489,541.93	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	14.11	902,475.60	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	214.25	1,024,757.75	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	67.75	1,100,802.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	31.66	1,179,366.66	
	CSL LIMITED	38,852	295.25	11,471,053.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	247,511	24.88	6,158,073.68	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,440	108.74	14,619,005.60	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	255,876	31.71	8,113,827.96	
	WESTPAC BANKING	283,793	23.95	6,796,842.35	
	ASX LTD	14,549	69.29	1,008,100.21	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,094	181.98	5,294,526.12	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.00	833,310.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	2.91	675,652.53	
	QBE INSURANCE GROUP	104,454	13.44	1,403,861.76	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	12.36	1,172,519.04	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	23.70	1,051,711.20	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	54.38	750,498.38	
	XERO LTD	11,340	73.64	835,077.60	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.15	1,280,138.05	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	7.29	1,104,194.43	
		5,524,148		132,925,860.32	

オーストラリアドル 小計				(11,821,096,758)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	8.36	985,401.56	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	24.99	999,100.20	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.21	902,810.37	
	MERCURY NZ LTD	64,613	5.85	378,309.11	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.29	584,777.76	
ニュージーランドドル 小計		506,126		3,850,399.00 (316,926,341)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	49.40	10,571,402.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	98.70	10,560,900.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	16.68	2,868,960.00	
	MTR CORP	125,000	42.40	5,300,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	16.24	1,948,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	54.35	9,456,900.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	29.75	5,890,500.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	24.85	3,625,615.00	
	WH GROUP LTD	658,301	4.69	3,087,431.69	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	26.95	7,586,425.00	
	HANG SENG BANK	59,400	127.50	7,573,500.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,400	361.40	34,116,160.00	
	AIA GROUP LTD	956,200	87.45	83,619,690.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	49.50	8,142,552.00	
	ESR GROUP LTD	157,000	17.14	2,690,980.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	14.98	2,591,540.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	29.50	3,694,226.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	22.90	3,122,987.50	
	SINO LAND CO	315,400	10.22	3,223,388.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	104,500	110.30	11,526,350.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	70.80	2,867,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	21.95	2,111,590.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	45.50	5,596,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	43.70	2,949,750.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	57.65	7,926,875.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	7.61	6,884,439.77	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	44.30	4,961,600.00	
香港ドル 小計		5,963,053		254,496,462.36 (4,181,376,876)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	28.59	228,720.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	7.32	825,696.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.50	515,900.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.82	630,492.24	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.97	599,625.00	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.07	726,902.00	
	DBS GROUP	140,400	34.53	4,848,012.00	
	OCBC BANK	282,100	12.59	3,551,639.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	29.21	2,742,819.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.22	608,520.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.86	862,710.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	8.07	345,396.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.75	320,625.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.05	463,885.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.45	1,668,310.35	
シンガポールドル 小計		2,772,975		18,939,251.59 (1,844,683,104)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	27.22	1,617,602.94	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	580.40	1,245,538.40	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	31.90	3,136,089.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	134,557	29.78	4,007,107.46	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.11	1,801,945.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	116.40	1,455,349.20	
	AZRIELI GROUP	4,323	235.60	1,018,498.80	
	NICE LTD	4,991	699.90	3,493,200.90	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	176,957	5.75	1,018,741.44	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	149.00	1,490,000.00	
イスラエルシェケル 小計		602,714		20,284,073.14 (766,447,902)	
合　計		89,122,522		485,195,101,079 (485,195,101,079)	

(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	109,658	1,159,085.06	
		LENDLEASE GROUP	64,786	540,315.24	
	オーストラリアドル 小計		174,444	1,699,400.30 (151,127,668)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,186,290.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,150,000.00	
	香港ドル 小計		535,500	4,336,290.00 (71,245,244)	
投資信託受益証券合計			709,944	222,372,912 (222,372,912)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,929,713.02	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	798,668.52	

		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,110	8,288,518.50	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	840,048.92	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	1,911,708.40	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	792,971.37	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	887,570.46	
		CROWN CASTLE INC	35,305	5,127,698.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,459,317.76	
		EQUINIX INC	7,423	5,216,587.48	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	946,143.50	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,592	1,796,530.32	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,125,373.05	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,630,200.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	21,791	1,130,299.17	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	635,360.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,204,501.65	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	969,682.84	
		INVITATION HOMES INC	51,127	1,581,869.38	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,191,958.60	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	1,012,542.58	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	667,480.24	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,427,615.70	
		PROLOGIS INC	73,626	8,930,097.54	
		PUBLIC STORAGE	12,922	3,715,721.10	
		REALTY INCOME CORP	49,865	3,256,683.15	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	793,948.06	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	2,527,264.35	
		SIMON PROPERTY GROUP	25,472	3,080,328.96	
		SUN COMMUNITIES INC	10,227	1,495,187.40	
		UDR INC	23,815	943,312.15	
		VENTAS INC	31,565	1,526,483.40	
		VICI PROPERTIES INC	75,143	2,493,244.74	
		WELLTOWER INC	37,724	2,702,924.60	
		WP CAREY INC	16,024	1,321,980.00	
	アメリカドル 小計		981,530	76,359,535.11 (9,828,235,764)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	230,813.01	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	347,440.70	
	カナダドル 小計		20,377	578,253.71 (55,269,489)	
	ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	300,697.20	
		GECINA SA	3,139	334,931.30	
		KLEPIERRE	17,225	387,562.50	

		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	583,911.75	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	371,148.36	
	ユーロ 小計		48,695	1,978,251.11 (275,708,857)	
	イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	345,927.38	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	391,884.01	
		SEGRO PLC	103,383	848,154.13	
	イギリスポンド 小計		239,086	1,585,965.52 (252,818,763)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	748,956.40	
		GOODMAN GROUP	133,807	2,567,756.33	
		GPT GROUP	167,884	752,120.32	
		MIRVAC GROUP	266,683	605,370.41	
		SCENTRE GROUP	381,283	1,155,287.49	
		STOCKLAND	207,412	804,758.56	
		VICINITY CENTERS	305,149	628,606.94	
	オーストラリアドル 小計		1,556,308	7,262,856.45 (645,885,824)	
	香港ドル	LINK REIT	170,500	10,809,700.00	
	香港ドル 小計		170,500	10,809,700.00 (177,603,371)	
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	792,745.02	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	460,429	953,088.03	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	455,934.29	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	393,800.00	
	シンガポールドル 小計		1,247,756	2,595,567.34 (252,808,258)	
投資証券合計			4,264,252	11,488,330,326 (11,488,330,326)	
合計				11,710,703,238 (11,710,703,238)	

(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　602銘柄	97.2%	—	—	69.7%

	投資証券　35銘柄	—	—	2.8%	2.0%
カナダドル	株式　86銘柄	99.7%	—	—	3.7%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式　223銘柄	99.5%	—	—	10.2%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式　77銘柄	98.9%	—	—	4.8%
	投資証券　3銘柄	—	—	1.1%	0.1%
スイスフラン	株式　43銘柄	100.0%	—	—	3.2%
スウェーデンクローナ	株式　45銘柄	100.0%	—	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　16銘柄	100.0%	—	—	0.9%
オーストラリアドル	株式　50銘柄	93.7%	—	—	2.4%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.2%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	5.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　5銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　27銘柄	94.4%	—	—	0.8%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.6%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	4.0%	0.0%
シンガポールドル	株式　15銘柄	87.9%	—	—	0.4%
	投資証券　4銘柄	—	—	12.1%	0.1%
イスラエルシェケル	株式　10銘柄	100.0%	—	—	0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	565,508,934
コール・ローン	748,768,842

	2023年 1月20日現在
項目	金額（円）
国債証券	84,563,945,179
未収利息	1,156,288,841
前払費用	78,638,895
流動資産合計	87,113,150,691
資産合計	87,113,150,691
負債の部	
流動負債	
未払解約金	22,090,364
未払利息	291
流動負債合計	22,090,655
負債合計	22,090,655
純資産の部	
元本等	
元本	48,149,126,521
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	38,941,933,515
元本等合計	87,091,060,036
純資産合計	87,091,060,036
負債純資産合計	87,113,150,691

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月20日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	48,149,126,521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 1.8088円 (1万口当たり純資産額) (18,088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

	2023年 1月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 1月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2023年 1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	短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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	2023年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月21日
期首元本額	47,259,879,384円
期中追加設定元本額	8,242,220,712円
期中一部解約元本額	7,352,973,575円
期末元本額	48,149,126,521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	4,961,952,565円
世界経済インデックスファンド	14,254,449,289円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	5,339,687,007円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	11,679,357,233円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	3,979,516円
コア投資戦略ファンド（安定型）	35,878,977円
コア投資戦略ファンド（成長型）	181,683,363円
新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	35,943,806円
分散投資コア戦略ファンドＡ	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドＳ	487,361,674円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	514,732,553円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,712,484,695円

区分	2023年 1月20日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	26,479,588円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	210,312,850円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	94,157,198円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	163,895,881円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	1,942,180,440円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	393,590,085円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	492,537,829円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	798,733,912円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	10,984,859円
グローバル経済コア	752,220,743円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	19,402,087円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	3,565,644円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	37,001,184円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	29,857,037円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	11,489,769円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	14,986,502円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国債券インデックス（ノーロード）	26,310,075円
１０資産分散投資ファンド	26,901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）	24,843,489円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	232,296,785円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	146,379,794円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	10,019,110円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	257,515,051円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	259,681,915円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	258,343,972円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	250,693,866円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	246,972,169円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,001,170,454
合計	3,001,170,454

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	35,299,590.00	
		MBONO 10% 12/05/24	104,250,000.00	104,960,173.93	
		MBONO 5.5% 03/04/27	46,000,000.00	40,877,900.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	160,060,368.12	
		MBONO 5% 03/06/25	32,500,000.00	29,718,325.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	133,498,380.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	158,100,000.00	150,862,182.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	76,163,230.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	32,100,000.00	30,068,712.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	100,100,000.00	99,977,878.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	95,948,664.00	
		MBONO 8% 07/31/53	28,000,000.00	25,761,132.60	
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	124,215,806.08	
		MBONO 8% 11/07/47	100,600,000.00	92,480,574.00	
		MBONO 8% 12/07/23	88,000,000.00	85,977,222.32	
	メキシコペソ 小計		1,346,950,000.00	1,285,870,138.05 (8,716,656,491)	
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	104,100,000.00	92,530,803.77	
		BLTN 0% 01/01/26	76,500,000.00	53,775,205.29	
		BLTN 0% 07/01/24	30,850,000.00	25,872,751.08	
		BLTN 0% 07/01/25	38,900,000.00	29,169,845.75	
		BNTNF 10% 01/01/25	63,800,000.00	61,011,817.11	
		BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000.00	38,112,959.97	
		BNTNF 10% 01/01/29	26,700,000.00	23,908,057.73	
		BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	12,074,268.42	
		BNTNF 10% 01/01/33	9,500,000.00	8,108,394.24	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,304,478.00	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,839,390.00	
	ブラジルレアル 小計		408,700,000.00	347,707,971.36 (8,639,291,339)	
	チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	625,000,000.00	534,972,175.00	

	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,757,819,011.01	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,920,000,000.00	1,858,303,560.96	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,160,000,000.00	2,086,114,685.76	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	2,156,868,598.82	
	BTPCL 5% 10/01/28	660,000,000.00	651,615,941.46	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,870,000,000.00	2,038,162,951.44	
	BTPCL 7% 05/01/34	280,000,000.00	320,768,034.72	
チリペソ 小計		12,710,000,000.00	12,404,624,959.17 (1,931,350,487)	
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	59,429,530,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	14,900,000,000.00	12,920,037,340.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	38,600,000,000.00	26,368,836,142.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	25,400,000,000.00	15,173,858,400.00	
コロンビアペソ 小計		144,200,000,000.00	113,892,261,882.00 (3,135,909,538)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,500,000.00	3,349,408.45	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	5,101,293.77	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,627,030.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	8,700,000.00	7,893,437.35	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	8,300,000.00	7,279,848.40	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,350,000.00	7,871,206.82	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	8,250,000.00	7,402,391.77	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	7,350,000.00	6,914,769.89	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	6,550,000.00	6,784,765.49	
ペルーソル 小計		62,050,000.00	56,224,151.94 (1,873,602,394)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	22,562,500.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	15,827,553.35	
ウルグアイペソ 小計		42,000,000.00	38,390,053.35 (126,172,749)	
ドミニカペソ	DOMREP 9.75% 06/05/26	33,000,000.00	32,257,500.00	
ドミニカペソ 小計		33,000,000.00	32,257,500.00 (73,201,944)	
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	19,572,651.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	58,138,380.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	44,948,450.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	68,900,000.00	54,737,880.60	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	21,726,000.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	72,000,000.00	57,146,400.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	54,071,550.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	15,027,400.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	51,500,000.00	41,895,250.00	

	CZGB 1% 06/26/26	62,800,000.00	55,529,016.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	62,700,000.00	58,502,109.60	
	CZGB 2.5% 08/25/28	53,300,000.00	48,455,030.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	80,500,000.00	73,278,345.00	
	CZGB 2% 10/13/33	64,500,000.00	52,533,057.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	20,537,000.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	34,394,430.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28	24,000,000.00	25,368,000.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	45,253,200.40	
	CZGB 5% 09/30/30	20,000,000.00	20,970,000.00	
	CZGB 6% 02/26/26	39,500,000.00	40,813,375.00	
チェココルナ 小計		948,900,000.00	842,897,524.60 (4,911,395,296)	
ハンガリーフォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	483,424,425.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	222,500,000.00	209,582,762.50	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	397,579,000.00	
	HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	661,773,321.50	
	HGB 2.25% 04/20/33	712,000,000.00	463,369,600.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	160,256,000.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	473,395,280.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	580,500,000.00	464,181,964.20	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	294,024,971.50	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	604,737,000.00	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	214,289,600.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	359,506,962.50	
	HGB 3% 08/21/30	615,000,000.00	469,245,000.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	470,847,200.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	230,527,000.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	193,000,000.00	164,406,664.00	
	HGB 4.75% 11/24/32	300,000,000.00	247,100,238.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	591,515,892.00	
	HGB 6.0% 11/24/23	476,000,000.00	450,971,539.20	
	HGB 6.75% 10/22/28	537,000,000.00	507,783,870.60	
ハンガリーフォリント 小計		10,020,000,000.00	7,918,518,291.00 (2,801,468,830)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	15,093,965.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	12,793,495.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	18,700,000.00	13,470,358.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	17,400,000.00	12,338,340.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	17,950,000.00	16,896,335.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	19,800,000.00	19,007,010.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	21,568,102.20	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	15,348,080.00	

	POLGB 2.75% 04/25/28	18,800,000.00	16,243,305.28	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	21,778,492.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	21,694,660.00	
	POLGB 3.75% 05/25/27	14,700,000.00	13,561,485.00	
	POLGB 4% 10/25/23	9,700,000.00	9,568,759.00	
ポーランドズロチ 小計		240,700,000.00	209,362,386.98 (6,182,869,076)	
ルーマニアレイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,441,844.27	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	1,200,000.00	1,154,160.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	6,500,000.00	5,759,199.87	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	12,600,000.00	11,712,125.62	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	6,000,000.00	4,652,100.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,506,008.60	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	10,500,000.00	9,154,465.95	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	6,400,000.00	5,235,626.62	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,138,334.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	3,200,000.00	3,075,232.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	5,800,000.00	4,564,165.00	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,395,604.50	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	2,800,000.00	2,439,108.00	
	ROMGB 4% 10/25/23	14,900,000.00	14,652,362.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	10,100,000.00	9,545,156.50	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,327,190.00	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	6,800,000.00	6,504,378.70	
ルーマニアレイ 小計		112,700,000.00	102,257,061.63 (2,895,858,631)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	27,300,000.00	24,919,631.10	
	MGS 3.478% 06/14/24	9,650,000.00	9,667,225.25	
	MGS 3.502% 05/31/27	18,650,000.00	18,641,278.14	
	MGS 3.582% 07/15/32	8,500,000.00	8,366,828.88	
	MGS 3.733% 06/15/28	19,000,000.00	19,071,677.50	
	MGS 3.757% 05/22/40	18,350,000.00	17,288,551.95	
	MGS 3.8% 08/17/23	4,800,000.00	4,821,288.00	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,040,677.36	
	MGS 3.882% 03/14/25	6,100,000.00	6,162,683.60	
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	20,369,158.04	
	MGS 3.899% 11/16/27	10,300,000.00	10,473,590.02	
	MGS 3.9% 11/30/26	14,450,000.00	14,678,580.21	
	MGS 3.906% 07/15/26	17,100,000.00	17,344,198.26	
	MGS 3.955% 09/15/25	23,000,000.00	23,269,373.70	
	MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000.00	19,763,718.64	
	MGS 4.065% 06/15/50	13,250,000.00	12,416,452.43	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,207,099.72	

	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	20,362,064.21	
	MGS 4.504% 04/30/29	7,700,000.00	8,010,667.28	
	MGS 4.696% 10/15/42	6,200,000.00	6,570,805.88	
	MGS 4.762% 04/07/37	9,550,000.00	10,174,060.98	
マレーシアリンギット 小計		291,100,000.00	289,619,611.15 (8,664,405,096)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	102,500,000.00	101,469,828.87	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	139,970,072.21	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	197,000,000.00	196,404,870.88	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	52,909,620.34	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	57,918,130.24	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	99,100,000.00	95,997,518.91	
	THAIGB 1% 06/17/27	163,000,000.00	157,243,417.02	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	126,100,000.00	127,663,413.02	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	123,000,000.00	124,349,789.70	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	90,100,000.00	86,021,849.65	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	151,000,000.00	158,491,457.30	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	67,105,835.46	
	THAIGB 2% 12/17/31	31,000,000.00	30,354,236.52	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	122,700,000.00	130,492,517.49	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	132,200,000.00	140,256,783.58	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	159,500,000.00	175,427,973.05	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	201,566,772.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	111,747,978.50	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	139,638,414.85	
タイバーツ 小計		2,247,800,000.00	2,295,030,479.59 (8,996,519,479)	
フィリピンペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	27,842,659.80	
フィリピンペソ 小計		30,000,000.00	27,842,659.80 (65,558,326)	
インドネシアルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,033,000,290.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,385,288,750.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	44,000,000,000.00	42,910,261,240.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	43,000,000,000.00	42,383,856,870.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	15,837,963,520.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,094,713,092.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	62,000,000,000.00	61,386,116,300.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	16,100,000,000.00	15,632,716,820.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	34,000,000,000.00	34,137,530,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	61,850,126,875.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	50,000,000,000.00	50,770,610,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,957,341,400.00	

		INDOGB 7.125% 06/15/42	31,300,000,000.00	32,099,160,990.00	
		INDOGB 7.125% 06/15/43	13,500,000,000.00	14,032,777,500.00	
		INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	35,881,859,200.00	
		INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	20,988,791,730.00	
		INDOGB 7.5% 06/15/35	34,700,000,000.00	37,137,733,990.00	
		INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,624,177,760.00	
		INDOGB 7% 02/15/33	14,000,000,000.00	14,411,810,000.00	
		INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	39,829,521,940.00	
		INDOGB 7% 09/15/30	43,000,000,000.00	44,253,527,400.00	
		INDOGB 8.125% 05/15/24	46,800,000,000.00	48,266,875,800.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/29	31,200,000,000.00	34,124,597,520.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	38,054,329,820.00	
		INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,829,110,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/24	57,600,000,000.00	59,359,530,240.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	49,929,554,400.00	
		INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	24,211,788,600.00	
		INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	43,062,002,540.00	
		INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	26,970,976,830.00	
		INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,389,403,740.00	
		INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	32,348,226,330.00	
	インドネシアルピア 小計		979,200,000,000.00	1,022,185,281,487.00 (8,790,793,420)	
	南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	181,400,000.00	195,212,158.80	
		SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	48,623,090.00	
		SAGB 6.5% 02/28/41	64,100,000.00	40,818,880.00	
		SAGB 7% 02/28/31	75,700,000.00	62,747,730.00	
		SAGB 8.25% 03/31/32	125,500,000.00	110,032,125.00	
		SAGB 8.5% 01/31/37	113,700,000.00	92,409,675.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	104,000,000.00	82,243,200.00	
		SAGB 8.75% 02/28/48	158,200,000.00	125,460,510.00	
		SAGB 8.875% 02/28/35	110,000,000.00	94,820,000.00	
		SAGB 8% 01/31/30	182,600,000.00	166,786,840.00	
		SAGB 9% 01/31/40	100,300,000.00	82,697,350.00	
	南アフリカランド 小計		1,287,700,000.00	1,101,851,558.80 (8,208,794,113)	
	オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,471,684.13	
		CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,126,510.32	
		CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	2,989,055.49	
		CGB 2.44% 10/15/27	6,500,000.00	6,421,001.27	
		CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,353,097.49	
		CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	5,941,935.12	
		CGB 2.6% 09/01/32	12,400,000.00	12,046,590.94	
		CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,934,785.24	

		CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,023,213.00	
		CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	9,797,462.60	
		CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,590,211.62	
		CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	10,840,558.15	
		CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	11,990,238.12	
		CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,793,009.15	
		CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,495,902.64	
		CGB 2.88% 11/05/23	6,900,000.00	6,943,908.15	
		CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	7,997,295.28	
		CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,042,942.00	
		CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,250,996.70	
		CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	9,933,460.32	
		CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,615,916.20	
		CGB 3.02% 10/22/25	22,300,000.00	22,623,630.98	
		CGB 3.03% 03/11/26	7,500,000.00	7,616,078.25	
		CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,412,656.00	
		CGB 3.13% 11/21/29	15,300,000.00	15,660,948.42	
		CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,416,946.33	
		CGB 3.22% 12/06/25	5,600,000.00	5,722,914.40	
		CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,510,549.60	
		CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,599,406.58	
		CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,802,843.80	
		CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	9,989,808.84	
		CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,708,993.32	
		CGB 3.29% 10/18/23	10,000,000.00	10,099,927.00	
		CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	9,167,906.88	
		CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	9,154,915.65	
		CGB 3.81% 09/14/50	16,500,000.00	18,017,353.20	
	オフショア人民元 小計		444,100,000.00	450,104,653.18 (8,550,097,970)	
合計				84,563,945,179 (84,563,945,179)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券　　15銘柄	100.0%	10.3%

ブラジルレアル	国債証券　11銘柄	100.0%	10.2%
チリペソ	国債証券　8銘柄	100.0%	2.3%
コロンビアペソ	国債証券　4銘柄	100.0%	3.7%
ペルーソル	国債証券　9銘柄	100.0%	2.2%
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　1銘柄	100.0%	0.1%
チェココルナ	国債証券　20銘柄	100.0%	5.8%
ハンガリーフォリント	国債証券　20銘柄	100.0%	3.3%
ポーランドズロチ	国債証券　13銘柄	100.0%	7.3%
ルーマニアレイ	国債証券　17銘柄	100.0%	3.4%
マレーシアリンギット	国債証券　21銘柄	100.0%	10.2%
タイバーツ	国債証券　19銘柄	100.0%	10.6%
フィリピンペソ	国債証券　1銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアルピア	国債証券　32銘柄	100.0%	10.4%
南アフリカランド	国債証券　11銘柄	100.0%	9.7%
オフショア人民元	国債証券　36銘柄	100.0%	10.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,792,418,748
コール・ローン	37,554,101
株式	112,381,411,947
投資信託受益証券	247,491,294
投資証券	117,983,567
派生商品評価勘定	235,409,096
未収入金	259,428
未収配当金	104,864,798
差入委託証拠金	1,128,082,480
流動資産合計	117,045,475,459
資産合計	117,045,475,459
負債の部	
流動負債	

	2023年 1月20日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	230
前受金	235,366,184
未払金	27,221
未払株式払込金	5,779,231
未払解約金	6,063,498
未払利息	14
流動負債合計	247,236,378
負債合計	247,236,378
純資産の部	
元本等	
元本	33,154,306,941
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	83,643,932,140
元本等合計	116,798,239,081
純資産合計	116,798,239,081
負債純資産合計	117,045,475,459

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 1月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。

	2023年 1月20日現在
	(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 1月20日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		33,154,306,941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	3.5229円
	(1万口当たり純資産額)	(35,229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

	2023年 1月20日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 1月20日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2023年 1月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月21日
期首元本額	28,827,989,077円
期中追加設定元本額	5,387,813,231円
期中一部解約元本額	1,061,495,367円
期末元本額	33,154,306,941円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン	7,799,067,307円
世界経済インデックスファンド	6,919,290,916円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	5,696,732,087円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	5,768,918,324円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	124,768,948円
分散投資コア戦略ファンドＡ	276,729,621円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,486,419,585円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	867,282,584円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	652,105,639円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	342,980,177円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	16,500,749円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	80,921,332円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	194,709,987円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	780,358,134円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	131,641,702円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,417,117円
グローバル経済コア	361,146,234円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	90,331,362円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	35,777,603円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	31,691,002円

区分	2023年 1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	12,872,817円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	17,554,927円
１０資産分散投資ファンド	8,110円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,282,585,275円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	96,867,103円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	71,841,688円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	9,786,611円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 1月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	10,726,144,531
投資信託受益証券	△28,345,895
投資証券	9,477,422
合計	10,707,276,058

(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

（2023年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,803,957,121	－	4,039,323,305	235,366,184
合計		3,803,957,121	－	4,039,323,305	235,366,184

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023年 1月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	23,115,600	－	23,158,512	42,912
	アメリカドル	23,115,600	－	23,158,512	42,912
	売建	12,865,610	－	12,865,840	△230
	アメリカドル	12,865,610	－	12,865,840	△230
合計		35,981,210	－	36,024,352	42,682

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.49	208,542.40	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	8.18	138,487.40	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	－	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	171	0.00	－	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	－	
	SOUTHERN COPPER CORP	11,571	76.16	881,247.36	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	53,727	28.33	1,522,085.91	
	NIO INC - ADR	171,200	10.77	1,843,824.00	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	24,287	46.90	1,139,060.30	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,058	7.79	319,841.82	
	TRIP.COM GROUP LTD	75,496	37.58	2,837,139.68	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	54,093	58.20	3,148,212.60	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	36.53	448,697.99	
	IQIYI INC-ADR	28,984	5.44	157,672.96	
	JOYY INC	6,185	36.95	228,535.75	
	KANZHUN LTD	22,125	23.42	518,167.50	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	8.23	934,491.81	
	VK CO LTD	19,368	0.00	－	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	21.20	111,278.80	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	－	

	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	—	
	PINDUODUO INC-ADR	65,522	90.22	5,911,394.84	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	52,765	14.95	788,836.75	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	—	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	6,299	54.56	343,673.44	
	ZAI LAB LTD-ADR	12,825	45.69	585,974.25	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	403,900	1.53	617,967.00	
	CREDICORP LTD	8,778	142.87	1,254,112.86	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	—	
	360 DIGITECH INC	8,061	21.60	174,117.60	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	2.61	297,887.13	
	KE HOLDINGS INC	80,573	19.15	1,542,972.95	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.82	126,061.26	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	24,700	3.11	76,891.10	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	44.48	348,500.80	
アメリカドル 小計		1,826,567		26,505,676.26 (3,411,545,591)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,063,461	9.27	19,128,283.47	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	422,992	80.35	33,987,407.20	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	286.79	4,158,455.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	38.98	6,959,956.96	
	ALFA S.A.B.-A	313,500	13.76	4,313,760.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	37,500	92.19	3,457,125.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	23,305	526.59	12,272,179.95	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	43,680	330.72	14,445,849.60	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	180.36	7,698,666.60	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	288,490	21.78	6,283,312.20	
	WALMART DE MEXICO-SER V	666,680	72.79	48,527,637.20	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	160.65	8,108,808.75	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	279,940	158.86	44,471,268.40	
	GRUMA S.A.B.-B	25,960	274.37	7,122,645.20	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	92.66	16,845,588.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	35.20	6,399,360.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	65,200	67.90	4,427,080.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	324,600	153.96	49,975,416.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	252,500	37.22	9,398,050.00	
	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	3,513,640	19.64	69,007,889.60	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	21.57	4,769,127.00	
メキシコペソ 小計		9,192,360		381,757,866.13 (2,587,860,222)	
ブラジルレアル	COSAN SA	162,100	17.46	2,830,266.00	
	PETRO RIO SA	84,700	40.52	3,432,044.00	

PETROBRAS - PETROLEO BRAS	496,300	29.50	14,640,850.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	576,440	25.83	14,889,445.20	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	12.87	972,972.00	
BRASKEM SA-PREF A	19,300	21.95	423,635.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	17.41	1,730,554.00	
GERDAU SA-PREF	141,800	33.50	4,750,300.00	
SUZANO SA	90,079	49.34	4,444,497.86	
VALE SA	504,687	93.74	47,309,359.38	
WEG SA	217,544	37.91	8,247,093.04	
CCR SA	125,600	11.99	1,505,944.00	
LOCALIZA RENT A CAR	92,735	56.91	5,277,548.85	
LOCALIZA RENT A CAR SA-RIGHTS	405	15.20	6,156.00	
RUMO SA	159,700	19.07	3,045,479.00	
LOJAS RENNER S.A.	115,947	20.80	2,411,697.60	
MAGAZINE LUIZA SA	305,500	3.81	1,163,955.00	
VIBRA ENERGIA SA	173,000	15.33	2,652,090.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	41,500	15.01	622,915.00	
RAIA DROGASIL SA	122,500	24.26	2,971,850.00	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	81,500	20.18	1,644,670.00	
AMBEV SA	628,600	13.64	8,574,104.00	
BRF SA	106,300	7.72	820,636.00	
JBS SA	110,000	21.70	2,387,000.00	
NATURA &CO HOLDING SA	100,308	12.25	1,228,773.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	613,154	4.37	2,679,482.98	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,600	29.52	1,346,112.00	
HYPERA SA	54,500	44.81	2,442,145.00	
BANCO BRADESCO S.A.	326,023	13.11	4,274,161.53	
BANCO BRADESCO SA-PREF	584,982	14.88	8,704,532.16	
BANCO DO BRASIL S.A.	116,000	39.11	4,536,760.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	612,281	26.57	16,268,306.17	
ITAUSA SA	774,657	8.69	6,731,769.33	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	799,809	12.97	10,373,522.73	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	69,000	35.04	2,417,760.00	
TOTVS SA	57,900	29.65	1,716,735.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	52,300	40.07	2,095,661.00	
TIM SA	96,100	11.64	1,118,604.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	43.72	1,617,640.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	159,400	41.70	6,646,980.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	11.68	2,474,139.36	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	55.34	2,794,670.00	
CPFL ENERGIA SA	27,200	33.08	899,776.00	
ENGIE BRASIL SA	46,250	38.70	1,789,875.00	

	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	27.39	4,522,089.00	
ブラジルレアル 小計		9,531,128		223,434,556.19 (5,551,544,356)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	44,730	6,156.00	275,357,880.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,489.00	202,451,885.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	18,037	68,612.00	1,237,554,644.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	70.50	173,513,754.00	
	FALABELLA SA	70,837	1,860.00	131,756,820.00	
	CENCOSUD SA	137,988	1,340.00	184,903,920.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	5,790.00	42,759,150.00	
	BANCO DE CHILE	4,862,640	82.90	403,112,856.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,193	23,810.00	147,455,330.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	32.18	371,684,438.42	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	114.29	399,022,391.35	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	37.50	96,047,925.00	
チリペソ 小計		25,347,725		3,665,620,993.77 (570,722,526)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	29,376	42,800.00	1,257,292,800.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	34,300.00	2,111,679,500.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	21,790.00	1,100,634,690.00	
コロンビアペソ 小計		141,452		4,469,606,990.00 (123,066,158)	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	9,898	21.42	212,015.16	
	OPAP SA	38,972	13.10	510,533.20	
	JUMBO SA	19,341	16.17	312,743.97	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.15	303,218.20	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.15	493,520.79	
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	4.07	300,230.28	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	14.44	378,429.08	
	PUBLIC POWER CORP	20,834	7.00	145,838.00	
	TERNA ENERGY SA	13,651	20.08	274,112.08	
ユーロ 小計		893,872		2,930,640.76 (408,443,402)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	11,603	584.10	6,777,312.30	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,755	40.36	4,712,231.80	
	HEKTAS TICARET T.A.S	133,067	38.20	5,083,159.40	
	SASA POLYESTER SANAYI	51,315	120.70	6,193,720.50	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	61.70	6,143,222.20	
	KOC HOLDING AS	89,884	79.45	7,141,283.80	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	44.36	13,252,461.28	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	154.60	13,390,679.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,501	509.00	3,309,009.00	

	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	42,824	135.30	5,794,087.20	
	AKBANK T.A.S.	276,321	17.59	4,860,486.39	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	42.84	9,055,176.48	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	11.62	4,467,460.06	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	9.70	3,599,931.90	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	37.32	5,340,156.12	
トルコリラ 小計		2,323,252		99,120,377.43 (678,647,488)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	700.00	9,312,100.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	79.30	4,814,303.00	
	CEZ AS	17,997	806.50	14,514,580.50	
チェココルナ 小計		92,010		28,640,983.50 (166,885,282)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,700.00	120,212,100.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,178	8,325.00	126,356,850.00	
	OTP BANK NYRT	29,500	11,395.00	336,152,500.00	
ハンガリーフォリント 小計		89,201		582,721,450.00 (206,159,273)	
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	83,330	63.30	5,274,789.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	146.40	2,955,230.40	
	LPP SA	124	10,440.00	1,294,560.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	132.50	888,280.00	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	19.05	687,666.90	
	ALLEGRO.EU SA	39,203	29.52	1,157,272.56	
	PEPCO GROUP NV	22,887	40.84	934,705.08	
	DINO POLSKA SA	5,945	354.70	2,108,691.50	
	BANK PEKAO SA	27,684	95.20	2,635,516.80	
	M BANK SA	1,423	331.00	471,013.00	
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	33.90	4,417,068.30	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	288.20	2,116,252.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	36.30	3,141,002.70	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	63,496	7.30	463,901.77	
ポーランドズロチ 小計		531,249		28,545,950.61 (843,016,158)	
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	1,310,610	0.00	0.13	
	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	—	
	NOVATEK PJSC	105,900	0.00	0.01	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	134,073	0.00	0.01	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,232,060	0.00	0.12	
	TATNEFT PJSC	179,460	0.00	0.01	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	7,220	0.00	—	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	195,980	0.00	0.01	

	PHOSAGRO PJSC	8,882	0.00	—	
	POLYUS PJSC	3,969	0.00	—	
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	—	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11	
	VTB BANK PJSC	756,074,000	0.00	75.60	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	—	
ロシアルーブル 小計		760,525,356		76.00 (141)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	6.35	2,089,150.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	9.00	2,178,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,343,400	4.05	13,540,770.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	460,000	24.50	11,270,000.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,648,000	3.88	10,274,240.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	196,000	25.80	5,056,800.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	4.01	1,363,400.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	144,500	29.75	4,298,875.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	219,000	8.66	1,896,540.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	412,000	7.04	2,900,480.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	4.56	1,313,280.00	
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.07	3,296,700.00	
	DONGYUE GROUP	147,000	9.25	1,359,750.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	64.80	3,501,792.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	67,000	13.26	888,420.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	7.30	2,657,200.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	95,000	15.10	1,434,500.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	9.06	1,639,860.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	729,000	12.58	9,170,820.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.94	1,083,500.00	
	BOC AVIATION LTD	23,800	65.55	1,560,090.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	2.99	586,040.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	16.18	3,931,740.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	9.35	1,196,800.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	4.26	3,007,560.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	170,000	9.19	1,562,300.00	
	CITIC LTD	768,000	8.83	6,781,440.00	
	CRRC CORP LTD-H	409,000	3.46	1,415,140.00	
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	7.56	2,177,280.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	23.30	1,817,400.00	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	8.14	1,302,400.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	211,800	11.60	2,456,880.00	
	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	141,216	7.75	1,094,424.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	43.15	2,688,245.00	

CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	3.53	1,359,311.22	
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	7.53	1,611,420.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	6.15	1,525,200.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	11.10	1,837,571.70	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	176,000	5.57	980,320.00	
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	7.95	4,118,497.50	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	6.49	1,627,523.26	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	7.54	2,427,880.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	137.60	2,408,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	8.10	1,153,334.70	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	6.71	2,080,100.00	
BYD CO LTD-H	108,500	226.60	24,586,100.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	4.64	1,234,240.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	37.50	2,190,000.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	758,000	11.86	8,989,880.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	10.62	5,243,625.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	5.61	2,010,309.84	
LI AUTO INC-CLASS A	135,142	85.00	11,487,070.00	
MINTH GROUP LTD	64,000	23.05	1,475,200.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	106,462	36.20	3,853,924.40	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	108,000	17.24	1,861,920.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	151,600	116.50	17,661,400.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	4.46	1,953,480.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	303,000	29.50	8,938,500.00	
LI NING CO LTD	292,000	72.55	21,184,600.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	99,600	101.60	10,119,360.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	10.48	1,729,200.00	
HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS	1,485,000	1.78	2,643,300.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	116,000	22.00	2,552,000.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	21.20	1,208,400.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	44,000	66.70	2,934,800.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	33.20	8,117,400.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	19.04	3,175,872.00	
BAIDU INC-CLASS A	281,900	125.10	35,265,690.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	202.80	5,394,480.00	
CHINA LITERATURE LTD	51,600	39.05	2,014,980.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	268,000	2.08	557,440.00	
KINGSOFT CORP LTD	92,000	28.55	2,626,600.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	243,400	68.15	16,587,710.00	
NETEASE INC	258,430	138.00	35,663,340.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	801,500	382.80	306,814,200.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,908,888	112.20	214,177,233.60	

ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	7.09	5,558,560.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	19.54	2,032,160.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	251.20	2,260,800.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	17.06	4,299,120.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	150,850	66.75	10,069,237.50	
JD.COM INC - CL A	283,411	231.80	65,694,669.80	
MEITUAN-CLASS B	651,350	160.20	104,346,270.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	21.90	1,176,030.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	26.10	1,686,060.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	114,000	7.66	873,240.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	44.90	4,130,800.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	137.40	2,088,480.00	
CHINA FEIHE LTD	564,000	7.83	4,416,120.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	402,000	37.10	14,914,200.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	208,000	61.10	12,708,800.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.65	897,900.00	
HUISHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
NONGFU SPRING CO LTD-H	227,600	43.25	9,843,700.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	12.16	2,371,200.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	228,000	13.00	2,964,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	88,000	78.05	6,868,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	7.83	626,400.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	560,000	5.50	3,080,000.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	28.85	1,384,800.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	39.80	3,482,500.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	23.80	595,000.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	35,200	64.45	2,268,640.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	25.65	1,692,900.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	13.68	5,461,056.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	14.00	1,797,600.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	19.22	3,674,864.00	
3SBIO INC	119,000	8.69	1,034,110.00	
BEIGENE LTD	79,105	163.40	12,925,757.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	13.88	3,428,360.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,144,160	9.16	10,480,505.60	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	5.91	2,003,490.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.82	1,856,520.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	27.70	3,656,400.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	110.30	562,530.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	16.64	2,030,080.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	139,000	42.50	5,907,500.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	67.75	2,266,237.50	

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	26.60	1,941,800.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,381,000	4.74	6,545,940.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	42,288	105.90	4,478,299.20	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	490,500	70.40	34,531,200.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,910,000	2.81	10,987,100.00	
BANK OF CHINA LTD-H	10,228,200	2.96	30,275,472.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	4.84	6,637,939.00	
CHINA CITIC BANK-H	951,200	3.75	3,567,000.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	12,669,620	5.08	64,361,669.60	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.50	937,500.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	494,923	49.65	24,572,926.95	
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.91	1,962,504.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	7,043,515	4.18	29,441,892.70	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,059,000	5.39	5,708,010.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	1.19	990,080.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.32	2,086,560.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	203,600	17.40	3,542,640.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	18.26	5,218,251.50	
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	7.26	1,742,400.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	13.24	1,173,064.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.49	1,961,028.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	10.04	2,670,640.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,106,000	14.74	16,302,440.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	21.05	8,137,930.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	10.90	2,005,861.60	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	96,400	21.70	2,091,880.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	939,000	2.62	2,460,180.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	889,288	7.51	6,678,552.88	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	819,000	60.45	49,508,550.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	26.80	3,111,480.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	85,000	24.30	2,065,500.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	625,900	1.82	1,139,138.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	468,540	21.65	10,143,891.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	10.68	2,403,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	405,111	38.65	15,657,540.15	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	67,600	44.55	3,011,580.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	16.44	5,186,820.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,852,654	2.78	5,150,378.12	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	232,000	20.30	4,709,600.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	12.20	884,500.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	5.76	1,036,800.00	
LONGFOR PROPERTIES	229,000	24.90	5,702,100.00	

	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	115,600	11.24	1,299,344.00	
	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	6.89	1,901,640.00	
	GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	22.45	2,844,415.00	
	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	311,000	17.22	5,355,420.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	16.76	1,324,040.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	20.55	1,469,325.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	60,500	26.00	1,573,000.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	30.30	2,030,100.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	9.23	636,870.00	
	LENOVO GROUP LTD	900,000	6.08	5,472,000.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	92,900	105.40	9,791,660.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,906,200	11.58	22,073,796.00	
	ZTE CORP-H	82,908	19.24	1,595,149.92	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,566,000	0.89	4,063,740.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	26.80	1,594,600.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.08	1,268,800.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	1.91	2,727,480.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	11.76	5,484,864.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	11.02	4,981,040.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	3.54	2,357,640.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,000	33.25	3,524,500.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	16.64	4,283,136.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	98,600	123.80	12,206,680.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	8.89	3,964,940.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	3.70	2,604,800.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	6.26	3,430,480.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	23.50	1,504,000.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	2.11	6,644,390.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	31.00	2,790,000.00	
	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	43,000	31.80	1,367,400.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	625,987	10.06	6,297,429.22	
香港ドル 小計		109,400,038		1,749,358,194.46 (28,741,955,134)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.57	1,063,126.76	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	25,100	22.88	574,288.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	269,900	8.50	2,294,150.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	480,200	5.29	2,540,258.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	7.02	268,164.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.39	803,866.94	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	7.26	773,872.44	

	MISC BHD	217,540	7.37	1,603,269.80	
	GENTING BHD	271,600	4.94	1,341,704.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.84	1,049,948.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.96	594,762.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.88	1,048,919.20	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	50,646	21.30	1,078,759.80	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	135.10	972,720.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	17.52	1,287,369.60	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.96	743,808.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.36	1,077,120.56	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	181,300	1.61	291,893.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.99	1,373,507.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	0.89	451,885.50	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	4.06	1,220,842.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	943,302	5.69	5,367,388.38	
	HONG LEONG BANK BERHAD	61,292	20.70	1,268,744.40	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	19.04	316,692.32	
	MALAYAN BANKING BHD	716,505	8.80	6,305,244.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,870,400	4.29	8,024,016.00	
	RHB BANK BHD	217,058	5.68	1,232,889.44	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	3.06	1,655,732.34	
	DIGI.COM BERHAD	498,000	4.20	2,091,600.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.98	1,066,242.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.19	1,409,354.88	
	PETRONAS GAS BHD	75,500	17.28	1,304,640.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	9.50	4,196,862.50	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.61	716,967.00	
マレーシアリンギット 小計		11,017,716		57,410,607.86 (1,717,524,450)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	172.00	34,537,600.00	
	PTT PCL-NVDR	1,393,600	33.50	46,685,600.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	130,305	58.00	7,557,690.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	41.75	8,617,200.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	51.25	24,914,367.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	55.25	11,199,175.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	102,600	356.00	36,525,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	527,000	74.50	39,261,500.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	9.65	7,884,050.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	8.60	6,961,700.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	6.20	5,023,860.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.00	11,970,354.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	44.00	8,016,800.00	

	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	14.80	12,433,998.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	289,000	23.80	6,878,200.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	36.25	6,438,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	783,800	68.75	53,886,250.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	101.50	4,699,450.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	24.20	13,464,880.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	30.00	8,793,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	184,900	16.50	3,050,850.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,176,900	30.25	35,601,225.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	211.00	17,449,700.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	83,200	153.50	12,771,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	17.40	7,632,510.00	
	SCB X PCL-NVDR	185,600	111.00	20,601,600.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	72,600	66.25	4,809,750.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	58.50	5,937,750.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	41.25	3,704,250.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	55.75	4,253,725.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	226,300	69.50	15,727,850.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	9.70	8,458,400.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	38,900	862.00	33,531,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	153,200	202.00	30,946,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	75.50	9,199,675.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	961,409	4.86	4,672,447.74	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	53,400	42.25	2,256,150.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	16,900	175.50	2,965,950.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	90.00	19,791,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	73.50	5,012,700.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	54.00	21,756,600.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	81,450	44.00	3,583,800.00	
タイバーツ 小計		14,926,171		629,464,607.24 (2,467,501,260)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	57.90	13,776,726.00	
	AYALA CORPORATION	28,280	746.00	21,096,880.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	303,513	57.50	17,451,997.50	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	930.50	33,763,192.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	218.00	33,382,340.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	248.00	15,130,480.00	
	MONDE NISSIN CORP	490,500	14.80	7,259,400.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	142.00	13,569,520.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	212,515	110.50	23,482,907.50	
	BDO UNIBANK INC	263,893	122.70	32,379,671.10	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	59.45	9,588,512.15	

	AYALA LAND INC	794,100	32.00	25,411,200.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,567,750	38.30	60,044,825.00	
	GLOBE TELECOM INC	5,044	2,156.00	10,874,864.00	
	PLDT INC	10,460	1,485.00	15,533,100.00	
	ACEN CORP	821,840	7.11	5,843,282.40	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	291.20	15,486,016.00	
フィリピンペソ 小計		5,296,287		354,074,914.15 (833,704,792)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	3,230.00	6,984,229,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	26,250.00	5,273,625,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,270.00	2,237,766,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	840.00	2,429,455,560.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,750.00	2,136,750,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	4,830.00	7,840,524,510.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	7,500.00	2,281,500,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	7,125.00	2,813,691,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,542,000	5,850.00	14,870,700,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,750.00	5,881,425,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	792,300	6,050.00	4,793,415,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	10,500.00	6,293,700,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,875.00	2,950,062,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	4,800.00	5,555,520,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	2,100.00	8,795,850,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	7,015,200	8,325.00	58,401,540,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	474,900	3,210.00	1,524,429,000.00	
	BANK MANDIRI	2,513,096	9,750.00	24,502,686,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	810,200	8,950.00	7,251,290,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	8,723,602	4,610.00	40,215,805,220.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,160.00	3,295,096,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	6,241,700	3,890.00	24,280,213,000.00	
インドネシアルピア 小計		49,274,508		240,609,272,790.00 (2,069,239,745)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	62,500.00	323,750,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	88,000.00	562,056,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,766	154,500.00	1,045,347,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,381	45,750.00	566,430,750.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	34,300.00	383,782,700.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	555,000.00	668,220,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	148,500.00	281,853,000.00	
	LG CHEM LTD	6,776	621,000.00	4,207,896,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	288,000.00	252,576,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	185,000.00	428,460,000.00	

POSCO CHEMICAL CO LTD	3,350	184,500.00	618,075,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	10,105	300,500.00	3,036,552,500.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	61,000.00	142,618,000.00	
SKC CO LTD	1,734	92,300.00	160,048,200.00	
CJ CORP	1,230	87,400.00	107,502,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	34,750.00	149,703,000.00	
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	55,063	16,100.00	886,514,300.00	
ECOPRO BM CO LTD	6,568	97,500.00	640,380,000.00	
GS HOLDINGS CORP	6,593	45,350.00	298,992,550.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	36,000.00	351,648,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	107,500.00	227,362,500.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,883	76,200.00	219,684,600.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	5,828	46,300.00	269,836,400.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4,354	75,200.00	327,420,800.00	
LG CORP	11,686	82,300.00	961,757,800.00	
LG ENERGY SOLUTION	4,893	456,000.00	2,231,208,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	11,910	119,000.00	1,417,290,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	23,950.00	443,458,200.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	5,090.00	484,410,210.00	
SK INC	4,545	193,000.00	877,185,000.00	
S-1 CORPORATION	3,573	58,600.00	209,377,800.00	
HMM CO LTD	35,545	21,350.00	758,885,750.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	182,500.00	509,722,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	23,739	24,700.00	586,353,300.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,990.00	178,118,640.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	33,050.00	233,531,300.00	
HANON SYSTEMS	19,000	8,690.00	165,110,000.00	
HYUNDAI MOBIS	8,137	208,000.00	1,692,496,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	16,824	164,000.00	2,759,136,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	80,700.00	487,589,400.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	80,300.00	276,954,700.00	
KIA CORP	32,718	64,300.00	2,103,767,400.00	
COWAY CO LTD	9,036	55,900.00	505,112,400.00	
F&F CO LTD / NEW	3,017	141,500.00	426,905,500.00	
LG ELECTRONICS INC	13,527	96,300.00	1,302,650,100.00	
KANGWON LAND INC	7,703	23,700.00	182,561,100.00	
CHEIL COMMUNICATIONS INC	9,880	22,550.00	222,794,000.00	
HYBE CO LTD	2,474	188,000.00	465,112,000.00	
KAKAO CORP	44,290	60,800.00	2,692,832,000.00	
KAKAO GAMES CORP	3,021	45,000.00	135,945,000.00	
KRAFTON INC	3,554	172,500.00	613,065,000.00	
NAVER CORP	17,071	196,000.00	3,345,916,000.00	

NCSOFT CORPORATION	1,939	469,000.00	909,391,000.00	
NETMARBLE CORP	2,465	57,300.00	141,244,500.00	
PEARL ABYSS CORP	4,605	44,150.00	203,310,750.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	83,500.00	364,310,500.00	
LOTTE SHOPPING CO	1,034	101,500.00	104,951,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	192,500.00	314,160,000.00	
EMART	3,594	106,000.00	380,964,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	775	345,000.00	267,375,000.00	
KT&G CORP	18,829	94,100.00	1,771,808,900.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	121,500.00	381,753,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	3,762	147,000.00	553,014,000.00	
LG H&H CO LTD	1,321	766,000.00	1,011,886,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	9,205	58,300.00	536,651,500.00	
HLB INC	11,376	31,200.00	354,931,200.00	
SD BIOSENSOR INC	3,909	29,600.00	115,706,400.00	
CELLTRION INC	12,774	164,000.00	2,094,936,000.00	
CELLTRION PHARM INC	2,066	66,000.00	136,356,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,179	256,500.00	302,413,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,224	801,000.00	1,781,424,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	72,200.00	230,823,400.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	77,200.00	162,120,000.00	
YUHAN CORPORATION	13,195	53,000.00	699,335,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	41,045	50,800.00	2,085,086,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,500.00	297,465,000.00	
KAKAOBANK CORP	18,421	27,200.00	501,051,200.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	55,773	57,200.00	3,190,215,600.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	59,426	42,450.00	2,522,633,700.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	77,054	12,500.00	963,175,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	61,700.00	283,943,400.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	47,904	6,990.00	334,848,960.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,910.00	214,313,650.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,450.00	114,411,150.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,776	35,550.00	205,336,800.00	
DB INSURANCE CO LTD	4,209	69,000.00	290,421,000.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	7,329	56,200.00	411,889,800.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	4,139	207,500.00	858,842,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	72,000.00	873,432,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,725	123,500.00	460,037,500.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,166	58,400.00	126,494,400.00	
L&F CO LTD	3,026	178,000.00	538,628,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	38,301	13,300.00	509,403,300.00	
LG INNOTEK CO LTD	1,415	277,000.00	391,955,000.00	

	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	6,845	152,000.00	1,040,440,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	610,572	61,500.00	37,550,178,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	107,783	55,500.00	5,981,956,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	6,847	610,000.00	4,176,670,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	11,400.00	252,225,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,459	20,300.00	537,117,700.00	
	SK HYNIX INC	68,932	85,500.00	5,893,686,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	11,660	35,300.00	411,598,000.00	
韓国ウォン 小計		2,047,928		126,262,275,210.00 (13,219,660,214)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,240	83.10	9,327,144.00	
	ASIA CEMENT CORP	234,176	42.65	9,987,606.40	
	CHINA STEEL	1,494,261	31.20	46,620,943.20	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	420,061	72.60	30,496,428.60	
	FORMOSA PLASTICS CORP	504,824	88.60	44,727,406.40	
	NAN YA PLASTICS CORP	647,752	75.00	48,581,400.00	
	TAIWAN CEMENT	913,419	36.00	32,883,084.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	999.00	18,538,443.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	348,028	32.35	11,258,705.80	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,525.00	13,725,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	309,213	47.70	14,749,460.10	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	18.95	8,811,750.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	28.40	10,962,400.00	
	EVERGREEN MARINE	123,215	152.50	18,790,287.50	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	29.10	13,735,200.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	73.60	5,493,136.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	62.00	13,454,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	34.50	6,108,604.50	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	19,937	491.50	9,799,035.50	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	207.00	14,582,736.00	
	GIANT MANUFACTURING	35,713	213.00	7,606,869.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	321.00	9,951,000.00	
	POU CHEN	273,780	34.30	9,390,654.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	42,000	626.00	26,292,000.00	
	MOMO.COM INC	6,000	798.00	4,788,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	271.50	24,039,696.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	645,395	67.90	43,822,320.50	
	PHARMAESSENTIA CORP	25,000	476.50	11,912,500.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	593,540	17.60	10,446,304.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,258,237	23.20	52,391,098.40	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,851,629	24.15	44,716,840.35	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,273,202	26.75	34,058,153.50	

HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,095,361	22.95	25,138,534.95	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,394,622	32.00	44,627,904.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,168,457	17.75	20,740,111.75	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,348,011	15.80	21,298,573.80	
TAIWAN BUSINESS BANK	780,000	13.45	10,491,000.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,110,787	26.70	29,658,012.90	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	484,985	47.10	22,842,793.50	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	180,375	230.00	41,486,250.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,389,633	22.70	31,544,669.10	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,099,057	42.00	46,160,394.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,896,226	13.05	24,745,749.30	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	954,906	59.80	57,103,378.80	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	8.97	17,328,838.02	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	310,086	43.90	13,612,775.40	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70,000	252.50	17,675,000.00	
ACER INC	255,803	24.50	6,267,173.50	
ADVANTECH CO LTD	43,336	338.00	14,647,568.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	92,092	268.00	24,680,656.00	
AUO CORP	756,072	15.85	11,983,741.20	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	175.00	20,772,500.00	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,390,080	11.45	15,916,416.00	
COMPAL ELECTRONICS	431,760	22.85	9,865,716.00	
DELTA ELECTRONICS INC	239,903	286.00	68,612,258.00	
E INK HOLDINGS INC	94,000	176.00	16,544,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,585,248	98.10	155,512,828.80	
INVENTEC CO LTD	280,511	25.70	7,209,132.70	
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,075.00	31,208,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	225,452	65.70	14,812,196.40	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	127.50	12,750,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	234.50	4,924,500.00	
PEGATRON CORP	340,474	64.70	22,028,667.80	
QUANTA COMPUTER INC	408,270	75.00	30,620,250.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	60.20	12,166,420.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	141,000	127.00	17,907,000.00	
WIWYNN CORP	8,000	785.00	6,280,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	260,692	47.50	12,382,870.00	
YAGEO CORPORATION	43,588	519.00	22,622,172.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	107.00	14,757,654.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	505,315	114.00	57,605,910.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	66.70	14,407,200.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	95.20	23,343,040.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	427,315	101.50	43,372,472.50	

	EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,500.00	9,000,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	24,000	493.00	11,832,000.00	
	MEDIATEK INC	196,804	693.00	136,385,172.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	115,000	57.70	6,635,500.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	74,045	348.00	25,767,660.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	893.00	7,144,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	301,000	32.30	9,722,300.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	316.50	19,605,276.00	
	SILERGY CORP	53,000	526.00	27,878,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,172,389	503.00	1,595,711,667.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,526,000	45.95	70,119,700.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	89,000	92.00	8,188,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	180.00	5,760,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	21.00	7,329,000.00	
新台湾ドル 小計		43,948,294		3,720,780,810.17 (15,757,134,652)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	96,221	349.25	33,605,184.25	
	COAL INDIA LTD	180,326	223.90	40,374,991.40	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	245.80	14,606,665.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	83.25	49,703,247.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	381,562	151.65	57,863,877.30	
	PETRONET LNG LTD	83,779	222.95	18,678,528.05	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	396,254	2,471.10	979,183,259.40	
	ACC LTD	14,288	2,390.85	34,160,464.80	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	519.00	38,163,627.00	
	ASIAN PAINTS LTD	46,971	2,868.05	134,715,176.55	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	563.00	16,579,787.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	31,529	1,678.65	52,926,155.85	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	180,501	499.35	90,133,174.35	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	604.90	42,206,292.60	
	JSW STEEL LTD	99,332	759.70	75,462,520.40	
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,248.50	41,571,054.50	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	18,199	2,451.40	44,613,028.60	
	SHREE CEMENT LTD	1,387	24,418.30	33,868,182.10	
	SRF LTD	19,164	2,137.95	40,971,673.80	
	TATA STEEL LTD	940,850	123.50	116,194,975.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	13,371	7,212.35	96,436,331.85	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	747.15	52,039,744.65	
	VEDANTA LTD	107,173	330.70	35,442,111.10	
	ABB LTD INDIA	5,256	2,918.75	15,340,950.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	34,272	3,461.60	118,635,955.20	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	102.75	52,135,863.75	

HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,206.30	43,023,895.80	
LARSEN & TOUBRO LTD	93,544	2,272.60	212,588,094.40	
SIEMENS INDIA LTD	11,025	3,046.80	33,590,970.00	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	640.20	14,720,118.60	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	64,743	776.05	50,243,805.15	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	711.70	18,828,023.50	
INTERGLOBE AVIATION LTD	14,831	2,121.60	31,465,449.60	
BAJAJ AUTO LTD	9,644	3,574.70	34,474,406.80	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,217.80	19,585,391.80	
BHARAT FORGE LTD	30,322	874.30	26,510,524.60	
EICHER MOTORS LTD	17,872	3,167.80	56,614,921.60	
HERO MOTOCORP LTD	12,238	2,767.45	33,868,053.10	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	110,799	1,319.70	146,221,440.30	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	15,707	8,502.85	133,554,264.95	
MRF LTD	432	90,510.00	39,100,320.00	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	186,639	74.20	13,848,613.80	
TATA MOTORS LTD	218,977	400.75	87,755,032.75	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	11,313	2,596.30	29,371,941.90	
TVS MOTOR CO LTD	18,276	1,013.80	18,528,208.80	
PAGE INDUSTRIES LTD	886	40,688.15	36,049,700.90	
TITAN CO LTD	46,501	2,385.35	110,921,160.35	
INDIAN HOTELS CO LIMITED	86,270	299.55	25,842,178.50	
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	510.70	22,435,051.00	
INFO EDGE INDIA LTD	7,855	3,715.50	29,185,252.50	
TRENT LTD	19,255	1,197.10	23,050,160.50	
ZOMATO LTD	427,818	51.10	21,861,499.80	
AVENUE SUPERMARTS LTD	21,281	3,565.60	75,879,533.60	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	14,526	4,370.00	63,478,620.00	
ITC LTD	414,459	332.10	137,641,833.90	
MARICO LTD	81,711	501.80	41,002,579.80	
NESTLE INDIA LIMITED	3,906	19,675.40	76,852,112.40	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	61,013	738.80	45,076,404.40	
UNITED SPIRITS LTD	32,483	834.55	27,108,687.65	
VARUN BEVERAGES LTD	20,941	1,224.70	25,646,442.70	
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	9,566	1,499.95	14,348,521.70	
DABUR INDIA LTD	79,726	554.80	44,231,984.80	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	928.90	58,888,544.40	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	104,076	2,650.25	275,827,419.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	13,485	4,313.40	58,166,199.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	445.15	15,764,987.25	
BIOCON LTD	58,256	249.05	14,508,656.80	
CIPLA LTD	59,934	1,065.00	63,829,710.00	

DIVI'S LABORATORIES LTD	14,782	3,377.75	49,929,900.50	
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,644	4,331.45	54,766,853.80	
LUPIN LTD	26,552	759.55	20,167,571.60	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	122,226	1,040.50	127,176,153.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,600.65	19,559,943.00	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	621.45	18,726,774.30	
AXIS BANK LTD	288,046	928.45	267,436,308.70	
BANDHAN BANK LTD	74,811	236.20	17,670,358.20	
ICICI BANK LTD	679,237	866.30	588,423,013.10	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	73,561	1,767.90	130,048,491.90	
STATE BANK OF INDIA	226,932	589.90	133,867,186.80	
YES BANK LTD	1,020,164	20.15	20,556,304.60	
BAJAJ FINANCE LTD	34,450	6,012.25	207,122,012.50	
BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,354.65	74,505,750.00	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,387	5,652.90	13,493,472.30	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	54,812	701.30	38,439,655.60	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	228,143	2,692.00	614,160,956.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,049.70	13,040,423.10	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	768.70	23,839,693.10	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	38,585	1,294.35	49,942,494.75	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	129,053	605.15	78,096,422.95	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,169.65	39,336,499.15	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	31,732	482.65	15,315,449.80	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	53,770	1,322.85	71,129,644.50	
DLF LTD	87,983	375.55	33,042,015.65	
GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,255.25	15,971,801.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	139,804	1,111.35	155,371,175.40	
INFOSYS LTD	443,828	1,541.30	684,072,096.40	
LTIMINDTREE LTD	10,316	4,244.30	43,784,198.80	
MPHASIS LTD	7,796	2,066.20	16,108,095.20	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	117,320	3,372.40	395,649,968.00	
TATA ELXSI LTD	4,179	6,299.75	26,326,655.25	
TECH MAHINDRA LTD	72,109	1,052.85	75,919,960.65	
WIPRO LTD	179,580	403.35	72,433,593.00	
BHARTI AIRTEL LTD	294,891	771.90	227,626,362.90	
INDUS TOWERS LTD	90,578	176.25	15,964,372.50	
ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	1,950.90	83,069,322.00	
ADANI POWER LTD	85,623	277.90	23,794,631.70	
ADANI TOTAL GAS LTD	33,068	3,848.70	127,268,811.60	
ADANI TRANSMISSION LTD	32,827	2,735.30	89,791,693.10	
GAIL INDIA LTD	262,152	97.50	25,559,820.00	
INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	419.90	11,221,407.60	

	NTPC LTD	664,141	168.45	111,874,551.45	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	380,361	220.75	83,964,690.75	
	TATA POWER CO LTD	199,512	205.25	40,949,838.00	
インドルピー 小計		13,160,905		9,723,619,934.10 (15,460,555,695)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	18.00	1,078,452.00	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	3.82	1,798,126.44	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.17	963,317.25	
	INDUSTRIES QATAR	196,788	13.71	2,697,963.48	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	5.18	2,752,605.38	
	MASRAF AL RAYAN	732,376	3.03	2,222,028.78	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	10.21	1,006,287.39	
	QATAR ISLAMIC BANK	206,340	19.00	3,920,460.00	
	QATAR NATIONAL BANK	590,025	17.60	10,384,440.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.87	595,703.79	
	OOREDOO QSC	72,800	9.25	673,400.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	17.79	1,716,948.48	
カタールリアル 小計		3,705,850		29,809,732.99 (1,053,475,963)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	217.51	7,442,539.67	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	302.16	4,432,687.20	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	5,906	1,390.00	8,209,340.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	51,324	384.00	19,708,416.00	
	GOLD FIELDS LTD	120,051	209.46	25,145,882.46	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	56,301	65.45	3,684,900.45	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	114,090	215.80	24,620,622.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	514.02	2,761,315.44	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	184.27	8,857,674.63	
	SASOL LTD	72,299	294.56	21,296,393.44	
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	48.55	19,173,560.20	
	BIDVEST GROUP LTD	27,702	223.57	6,193,336.14	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	119.66	4,849,700.14	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	177.44	5,058,814.40	
	NASPERS LTD-N SHS	27,673	3,344.94	92,564,524.62	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	144,533	21.12	3,052,536.96	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	114.89	4,314,579.06	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	110,495	73.33	8,102,598.35	
	BID CORP LTD	43,999	355.07	15,622,724.93	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	276.52	9,794,891.44	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	60,003	244.38	14,663,533.14	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,274	137.86	3,208,553.64	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	147.15	8,267,181.30	

	ABSA GROUP LTD	109,198	196.98	21,509,822.04	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	11,355	1,874.55	21,285,515.25	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	215.33	13,589,691.63	
	STANDARD BANK GROUP LTD	173,745	169.23	29,402,866.35	
	FIRSTRAND LTD	699,138	64.36	44,996,521.68	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	327.27	5,624,789.49	
	REMGRO LTD	74,679	138.81	10,366,191.99	
	DISCOVERY LIMITED	59,544	136.53	8,129,542.32	
	OLD MUTUAL LTD	974,656	11.57	11,276,769.92	
	SANLAM LTD	214,053	53.69	11,492,505.57	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	60,556	108.86	6,592,126.16	
	MTN GROUP LTD	219,239	135.23	29,647,689.97	
	VODACOM GROUP	84,493	124.36	10,507,549.48	
南アフリカランド 小計		4,314,053		545,447,887.46 (4,063,586,761)	
アラブ首長国連邦ディルハム	MULTIPLY GROUP	392,077	4.73	1,854,524.21	
	Q HOLDING PJSC	189,678	3.80	720,776.40	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	4.50	1,998,099.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	327,038	8.78	2,871,393.64	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	9.12	1,694,322.72	
	DUBAI ISLAMIC BANK	335,455	5.60	1,878,548.00	
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	12.70	3,432,302.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	596,059	15.70	9,358,126.30	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	487,034	4.37	2,128,338.58	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	576,832	5.85	3,374,467.20	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	435,702	25.70	11,197,541.40	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		4,239,938		40,508,439.45 (1,421,846,224)	
クウェートディナール	AGILITY	157,695	0.58	92,093.88	
	BOUBYAN BANK K.S.C	152,875	0.80	123,675.87	
	GULF BANK	137,143	0.30	41,965.75	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	932,130	0.82	764,346.60	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	974,155	1.10	1,071,570.50	
	MABANEE CO KPSC	133,798	0.83	111,186.13	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.56	166,224.80	
クウェートディナール 小計		2,784,626		2,371,063.53 (1,001,584,656)	
オフショア人民元	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	20,000	28.56	571,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	5.10	510,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	19.89	1,913,418.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	11.80	939,280.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	19.92	197,208.00	

YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	32.09	898,520.00	
YANZHOU COAL MINING CO-A	20,700	35.08	726,156.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.03	826,429.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	29.06	855,526.40	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	38,700	6.08	235,296.00	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	40.33	830,798.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	14.59	1,345,198.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	27.40	569,920.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	75.78	848,736.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	46.68	1,158,877.68	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	16.72	620,312.00	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	7.34	1,082,650.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	2,400	89.10	213,840.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	15.69	156,900.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.94	894,340.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.38	262,800.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	14.67	327,141.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	104.99	818,922.00	
LB GROUP CO LTD-A	15,300	20.22	309,366.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	19.02	895,842.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	13.20	1,045,440.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	5.00	97,500.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	24.79	1,180,004.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	12.41	601,264.50	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	17.59	975,805.25	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	19.37	140,471.24	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	34.58	620,365.20	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.51	1,005,966.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	11,200	52.87	592,144.00	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	9.28	1,017,811.84	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	4.49	616,926.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	15.28	753,304.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	49.50	534,600.00	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	600	248.22	148,932.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	23.25	1,160,175.00	
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TE-A	16,100	61.67	992,887.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	89.03	1,014,942.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	15.28	149,744.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.53	1,170,548.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	17,500	95.85	1,677,375.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	9,220	68.70	633,414.00	
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	11,775	94.99	1,118,507.25	

YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,400	106.78	149,492.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	152.29	624,389.00	
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	27.17	1,016,158.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	64.40	477,204.00	
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	43,000	23.11	993,730.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	105,600	11.58	1,222,848.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	43.60	497,040.00	
AVICOPTER PLC-A	15,500	45.63	707,265.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	28.35	238,140.00	
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	12.12	775,680.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	23.60	1,303,074.00	
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.31	1,393,161.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	210,900	5.39	1,136,751.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	17,700	446.77	7,907,829.00	
CRRC CORP LTD-A	185,800	5.24	973,592.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	21.39	924,048.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	7,573	83.75	634,238.75	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	6.37	145,236.00	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	171.70	412,080.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	31.30	181,540.00	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	102.55	646,065.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	37.05	975,156.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	67.93	778,206.08	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	15.16	623,076.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	17.98	864,838.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.29	1,088,661.00	
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	26.82	970,884.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	69,984	26.92	1,883,969.28	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	3,300	326.31	1,076,823.00	
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	64.28	805,685.52	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	76.66	895,005.50	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	20.73	837,492.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	6.93	1,130,976.00	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	296.78	816,738.56	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	17.12	717,328.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	67.81	1,925,329.33	
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	17,900	11.32	202,628.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	120.10	1,201,000.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	22.62	920,634.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	446.20	1,142,272.00	
TBEA CO LTD-A	22,519	20.43	460,063.17	
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	11.05	477,360.00	

WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	5,320	111.46	592,967.20	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	5.58	1,112,652.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	11.33	227,857.63	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	33.12	1,046,592.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	51.00	421,260.00	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	12.41	1,119,382.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	5.79	463,779.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	42,581	4.78	203,537.18	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	57.51	632,610.00	
AIR CHINA LTD-A	25,900	10.69	276,871.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.39	215,600.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	10.27	1,884,545.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	6.66	1,068,930.00	
S F HOLDING CO LTD-A	20,300	61.03	1,238,909.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	61.83	328,873.77	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.27	233,988.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	21.22	1,181,954.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	13.23	288,943.20	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	26,300	81.78	2,150,814.00	
BYD CO LTD -A	9,700	270.50	2,623,850.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	129.19	1,162,710.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	13.22	573,113.44	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	37.32	690,420.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	17.67	606,081.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	122.56	1,029,504.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	15.32	448,876.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	64.09	44,863.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.75	628,350.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	21.80	855,737.20	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	88.58	248,024.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	35.10	1,526,850.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	31.03	861,392.80	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	44.56	353,449.92	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	128.00	985,600.00	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	26,000	26.36	685,360.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	102,000	4.13	421,260.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	52.36	418,880.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	57.27	1,500,474.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	5.44	431,392.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	15.02	502,869.60	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	21.11	517,195.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	9.42	504,912.00	

FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	7.00	975,800.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	360.28	1,044,812.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	32.90	536,270.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	14.36	327,408.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	3.96	243,540.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,200	231.64	2,826,008.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	7.87	869,635.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	18,576	39.03	725,021.28	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	59.21	600,389.40	
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	42.95	459,565.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	293.00	468,800.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	56.84	125,048.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	69.45	1,270,935.00	
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	160.23	480,690.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	8.74	520,030.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	125.18	988,922.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	26.20	120,520.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	20,248	80.65	1,633,001.20	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	22.75	623,350.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	63.37	1,077,290.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	25.67	30,804.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	32.42	1,112,070.84	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	57.85	1,000,805.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	184.47	1,678,677.00	
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	141.88	794,528.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	39.10	449,650.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	54.16	379,120.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	9,200	1,880.21	17,297,932.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,800	247.38	2,424,324.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	47.99	1,610,448.42	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	12.80	343,040.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	298.48	2,799,742.40	
TONGWEI CO LTD-A	31,600	40.94	1,293,704.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	20.75	791,820.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	30,200	205.30	6,200,060.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	45.60	460,560.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	16.93	89,729.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	23.89	709,533.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	70,574	34.20	2,413,630.80	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	30.18	482,880.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	86.14	244,465.32	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	48.70	473,364.00	

JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	34.66	428,051.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	13.65	141,960.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	24.04	355,792.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	6.41	159,224.40	
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	38.17	275,167.53	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	8,400	341.51	2,868,684.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	169.09	338,180.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	171.85	48,118.00	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	46.65	1,324,860.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	7,491	138.88	1,040,350.08	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	62.36	1,003,996.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	54.48	299,640.00	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	132.69	1,203,100.23	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	213.80	470,360.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	47.67	486,234.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	105.48	1,044,252.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	44.03	977,157.79	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	124.93	999,440.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	23.49	442,786.50	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	631.00	1,312,480.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	38,102	43.64	1,662,771.28	
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	11,116	67.14	746,328.24	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	19.64	543,674.48	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	61.63	1,175,777.14	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	6.40	410,240.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	37.93	412,678.40	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	36.86	258,020.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	28.57	269,700.80	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	28.11	315,731.52	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	40.99	696,830.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	16,464	97.49	1,605,075.36	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	57.88	575,327.20	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	3,900	312.80	1,219,920.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	22.10	199,342.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	19.30	672,566.40	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	56.37	546,789.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	353,600	2.92	1,032,512.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.26	247,080.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	98,900	4.88	482,632.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	13.31	1,500,037.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.52	1,727,644.80	
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	10.64	1,569,400.00	

BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	33.26	1,939,058.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.04	274,820.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	5.62	701,938.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	128,900	3.09	398,301.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	137,700	40.65	5,597,505.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.48	952,128.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	2.99	922,714.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.21	622,074.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	4.33	2,505,338.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	95,200	18.07	1,720,264.00	
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	15.09	1,801,746.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.83	683,445.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	138,300	7.33	1,013,739.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	4.49	550,025.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	11.53	915,482.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.98	457,493.40	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.89	117,211.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	9.48	442,716.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	14.59	418,149.40	
CITIC SECURITIES CO-A	49,680	21.62	1,074,081.60	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	27.18	655,038.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	97,856	23.34	2,283,959.04	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	16.48	59,328.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	6.12	368,424.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	18.16	1,100,496.00	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	6.78	1,163,983.62	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.41	1,041,843.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.29	1,108,444.50	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	120.40	650,160.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	13.05	411,075.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	7.03	803,318.10	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	11.15	452,422.40	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.24	878,528.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	4.10	467,400.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.94	478,078.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,200	25.84	470,288.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	66,800	51.81	3,460,908.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	14.67	802,449.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	18.55	996,135.00	
GEMDALE CORP-A	45,500	9.86	448,630.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	15.70	1,284,260.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	21.16	270,848.00	

360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	7.04	189,376.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	294.68	1,421,241.64	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	26,460	16.60	439,236.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.15	342,555.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	46.39	768,311.18	
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	38.61	416,988.00	
NAVINFO CO LTD-A	33,200	11.82	392,424.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	155.00	465,000.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	7,943	48.26	383,329.18	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	106.00	583,000.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	25.32	333,464.40	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	29.58	1,121,082.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	4.04	462,984.00	
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	20,100	33.96	682,596.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	35.00	980,000.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	11.15	388,020.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	114.77	1,044,407.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	9.53	429,803.00	
GOERTEK INC -A	26,900	18.72	503,568.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	4.99	249,500.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	64.92	454,440.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	23.78	468,751.36	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	11.26	189,168.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	31.00	1,439,950.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	138.00	238,464.00	
NINESTAR CORP-A	18,543	53.98	1,000,951.14	
OFILM GROUP CO LTD-A	31,300	5.05	158,065.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	16.00	388,800.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	77.39	368,376.40	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	87.14	560,745.90	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	26.50	755,250.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.38	440,860.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	18,340	23.85	437,409.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	59.55	250,110.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	41,316	11.49	474,720.84	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	174.46	819,962.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	61.66	693,675.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	12.59	381,477.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	28.86	251,082.00	
ZTE CORP-A	12,600	26.81	337,806.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	5.17	2,185,876.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	6.00	1,042,800.00	

	CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	5.75	1,387,475.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	20.42	3,673,149.60	
	ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	18.14	1,008,584.00	
	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	4.07	1,284,899.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	12.54	1,157,442.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	108.93	773,076.21	
	AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	80.79	819,049.02	
	CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	56.44	1,187,046.08	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	82,500	3.07	253,275.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	118.83	745,301.76	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	15,120	73.10	1,105,272.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	35.65	267,375.00	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	79.73	597,975.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	24,430	65.59	1,602,363.70	
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	26.91	801,918.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	47,040	44.73	2,104,099.20	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	62.97	1,325,833.35	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	245.66	761,546.00	
	SG MICRO CORP-A	3,150	187.20	589,680.00	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	117.50	928,250.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	347.99	974,372.00	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	29,500	40.90	1,206,550.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	8.89	291,147.50	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	18.28	410,678.48	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	71.25	1,811,032.50	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	126.60	868,349.40	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	97.45	710,410.50	
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	59.24	841,208.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	66.61	1,133,835.42	
オフショア人民元 小計		16,719,866		300,130,614.12 (5,701,221,119)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	10.96	492,531.44	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	306,676	32.20	9,874,967.20	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	46.60	548,715.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	12.76	407,401.28	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	28,237	139.00	3,924,943.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	37.50	1,771,537.50	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	106,575	74.80	7,971,810.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	119,170	94.50	11,261,565.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,414	23.98	921,167.72	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	13.18	1,363,220.58	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	26,556	42.40	1,125,974.40	

	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	194.40	817,840.80	
	JARIR MARKETING CO	12,500	150.40	1,880,000.00	
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	177.00	1,138,287.00	
	ALMARAI CO	30,130	56.00	1,687,280.00	
	SAVOLA	25,336	29.20	739,811.20	
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	132.80	907,422.40	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	227.80	2,669,132.60	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	209.00	1,664,058.00	
	AL RAJHI BANK	248,500	77.70	19,308,450.00	
	ALINMA BANK	124,211	32.30	4,012,015.30	
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	28.70	2,469,089.70	
	BANK AL-JAZIRA	35,813	19.00	680,447.00	
	BANK ALBILAD	61,145	44.65	2,730,124.25	
	BANQUE SAUDI FRANSI	67,536	40.00	2,701,440.00	
	RIYAD BANK	166,012	32.00	5,312,384.00	
	SAUDI BRITISH BANK	116,762	35.90	4,191,755.80	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	17.48	1,234,787.20	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	276,263	48.05	13,274,437.15	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	3,929	167.00	656,143.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	7,578	146.40	1,109,419.20	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	11.78	1,189,673.98	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	8.09	373,652.83	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	243.00	1,073,331.00	
	ELM CO	2,436	336.00	818,496.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	48,844	36.00	1,758,384.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	10.66	964,815.28	
	SAUDI TELECOM CO	183,517	37.50	6,881,887.50	
	ACWA POWER CO	9,184	161.80	1,485,971.20	
	SAUDI ELECTRICITY CO	111,901	23.34	2,611,769.34	
サウジアラビアリアル 小計		2,832,463		126,006,138.85 (4,324,530,685)	
合　計		1,094,162,815		112,381,411,947 (112,381,411,947)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	7,784,136.00	
	メキシコペソ 小計		58,400	7,784,136.00 (52,767,101)	
		BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	2,896,945.00	

	ブラジルレアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,355,886.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,575,288.00	
		KLABIN SA-UNIT	100,000	2,009,000.00	
	ブラジルレアル 小計		314,800	7,837,119.00 (194,724,193)	
投資信託受益証券合計			373,200	247,491,294 (247,491,294)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	9,733,745.00	
	メキシコペソ 小計		391,700	9,733,745.00 (65,983,110)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	6,979,927.14	
	南アフリカランド 小計		478,733	6,979,927.14 (52,000,457)	
投資証券合計			870,433	117,983,567 (117,983,567)	
合計				365,474,861 (365,474,861)	

(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　35銘柄	100.0%	—	—	3.0%
メキシコペソ	株式　21銘柄	95.6%	—	—	2.3%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	1.9%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	2.4%	0.1%
ブラジルレアル	株式　45銘柄	96.6%	—	—	4.9%
	投資信託受益証券　4銘柄	—	3.4%	—	0.2%
チリペソ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.5%
コロンビアペソ	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.1%
ユーロ	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.4%
トルコリラ	株式　15銘柄	100.0%	—	—	0.6%
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%	—	—	0.2%

ポーランドズロチ	株式　14銘柄	100.0%	—	—	0.7%
ロシアルーブル	株式　14銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式　193銘柄	100.0%	—	—	25.5%
マレーシアリンギット	株式　34銘柄	100.0%	—	—	1.5%
タイバーツ	株式　42銘柄	100.0%	—	—	2.2%
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%	—	—	1.8%
韓国ウォン	株式　102銘柄	100.0%	—	—	11.7%
新台湾ドル	株式　88銘柄	100.0%	—	—	14.0%
インドルピー	株式　113銘柄	100.0%	—	—	13.7%
カタールリアル	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.9%
南アフリカランド	株式　36銘柄	98.7%	—	—	3.6%
	投資証券　1銘柄	—	—	1.3%	0.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式　11銘柄	100.0%	—	—	1.3%
クウェートディナール	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.9%
オフショア人民元	株式　328銘柄	100.0%	—	—	5.1%
サウジアラビアリアル	株式　40銘柄	100.0%	—	—	3.8%

(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11期中間計算期間(2023年1月21日から2023年7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。

【ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 （2023年 1月20日現在）	第11期中間計算期間 （2023年 7月20日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	129,561,817	155,374,677
親投資信託受益証券	12,948,923,733	16,731,659,930
未収入金	930,000	64,370,000
流動資産合計	13,079,415,550	16,951,404,607
資産合計	13,079,415,550	16,951,404,607
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,005,324	12,266,307
未払受託者報酬	2,846,624	3,192,968
未払委託者報酬	36,294,421	40,710,292
未払利息	50	348
その他未払費用	355,769	399,054
流動負債合計	44,502,188	56,568,969
負債合計	44,502,188	56,568,969
純資産の部		
元本等		
元本	6,626,603,018	7,386,660,534
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6,408,310,344	9,508,175,104
（分配準備積立金）	2,461,322,552	2,345,322,668
元本等合計	13,034,913,362	16,894,835,638
純資産合計	13,034,913,362	16,894,835,638
負債純資産合計	13,079,415,550	16,951,404,607

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期中間計算期間 自　2022年 1月21日 至　2022年 7月20日	第11期中間計算期間 自　2023年 1月21日 至　2023年 7月20日
営業収益		
受取利息	377	225
有価証券売買等損益	240,348,134	2,284,066,197
営業収益合計	240,348,511	2,284,066,422
営業費用		
支払利息	18,786	31,132
受託者報酬	2,497,766	3,192,968
委託者報酬	31,846,473	40,710,292
その他費用	312,158	399,054
営業費用合計	34,675,183	44,333,446
営業利益又は営業損失（△）	205,673,328	2,239,732,976
経常利益又は経常損失（△）	205,673,328	2,239,732,976
中間純利益又は中間純損失（△）	205,673,328	2,239,732,976
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（△）	△4,419,560	43,462,013
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,549,762,701	6,408,310,344
剰余金増加額又は欠損金減少額	768,083,565	1,228,586,803
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	768,083,565	1,228,586,803
剰余金減少額又は欠損金増加額	284,234,526	324,993,006
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	284,234,526	324,993,006
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6,243,704,628	9,508,175,104

（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10期 (2023年 1月20日現在)	第11期中間計算期間 (2023年 7月20日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	6,626,603,018口	7,386,660,534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 1.9671円 (1万口当たり純資産額) (19,671円)	1口当たり純資産額 2.2872円 (1万口当たり純資産額) (22,872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11期中間計算期間 (2023年 7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。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第10期 自 2022年 1月21日 至 2023年 1月20日	第11期中間計算期間 自 2023年 1月21日 至 2023年 7月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,555,620,315円	6,626,603,018円
期中追加設定元本額	1,616,941,215円	1,093,915,102円
期中一部解約元本額	545,958,512円	333,857,586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。

国内債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	293,934,777
国債証券	547,445,419,170
地方債証券	33,056,844,602
特殊債券	37,042,853,346
社債券	29,529,178,000
未収入金	1,057,516,200
未収利息	1,062,347,310
前払費用	40,051,109
流動資産合計	649,528,144,514
資産合計	649,528,144,514

	2023年 7月20日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
未払金	800,000,000
未払解約金	279,673,880
未払利息	659
流動負債合計	1,079,674,539
負債合計	1,079,674,539
純資産の部	
元本等	
元本	476,040,194,213
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	172,408,275,762
元本等合計	648,448,469,975
純資産合計	648,448,469,975
負債純資産合計	649,528,144,514

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 7月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	476,040,194,213口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
	有価証券 100,116,000円
3.	1口当たり純資産額 1.3622円

	2023年 7月20日現在
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額) (13,622円)

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

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2023年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月21日
期首元本額	458,486,364,988円
期中追加設定元本額	30,323,261,716円
期中一部解約元本額	12,769,432,491円
期末元本額	476,040,194,213円
期末元本額の内訳	

区分	2023年 7月20日現在
エマージング株式オープン	2,227,240円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	5,435,630,864円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	15,553,656円
ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン	20,037,321,860円
世界経済インデックスファンド	5,710,008,054円
ＤＣマイセレクション２５	28,142,948,409円
ＤＣマイセレクション５０	33,460,654,037円
ＤＣマイセレクション７５	10,681,510,915円
ＤＣ日本債券インデックス・オープン	422,831,649円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ	90,996,998,065円
ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ	64,330,614,401円
ＤＣマイセレクションＳ２５	15,418,197,365円
ＤＣマイセレクションＳ５０	17,835,734,121円
ＤＣマイセレクションＳ７５	4,305,729,866円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	591,396,482円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	2,559,658,880円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	991,337,342円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	4,413,172,705円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,105,261円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	19,141,909円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,961,710円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,103,784円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	61,788,166円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	108,513,635円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	28,069,651円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	24,022,632円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,328,173,632円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	740,944,059円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,181,221,156円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	64,171,905円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	49,798,808円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	928,889,098円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,037,200,399円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,357,755,913円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	104,048,252円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	5,640,983,636円
日本債券ファンド・シリーズ１	16,949,185,588円
分散投資コア戦略ファンドＡ	19,225,644,223円
分散投資コア戦略ファンドＳ	25,755,853,956円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	270,687,240円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,766,393,935円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	98,267,564円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,234,115円

区分	2023年 7月20日現在
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	73,370,291円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	44,478,817円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	96,374,221円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	151,767,494円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	14,999,501円
グローバル経済コア	231,391,015円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	39,408,538円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	26,127,376円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	109,077,412円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	62,803,967円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	17,707,205円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	12,028,004円
Ｍｙ　ＳＭＴ　国内債券インデックス（ノーロード）	398,669,441円
１０資産分散投資ファンド	301,745,252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）	88,803,435,970円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	40,691,367円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,180,665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）	455,251,539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。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,383,069,479
株式	551,849,520,170
派生商品評価勘定	37,392,000
未収入金	731,450
未収配当金	782,077,770
差入委託証拠金	82,608,000
流動資産合計	555,135,398,869
資産合計	555,135,398,869
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,940,400
前受金	31,489,000
未払解約金	107,629,970
未払利息	5,350

	2023年 7月20日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	145,064,720
負債合計	145,064,720
純資産の部	
元本等	
元本	241,603,393,016
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	313,386,941,133
元本等合計	554,990,334,149
純資産合計	554,990,334,149
負債純資産合計	555,135,398,869

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7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）

		2023年 7月20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	241,603,393,016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 2.2971円 (1万口当たり純資産額) (22,971円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月21日
期首元本額	260,822,185,787円
期中追加設定元本額	10,152,260,879円
期中一部解約元本額	29,371,053,650円
期末元本額	241,603,393,016円

区分	2023年 7月20日現在
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）	333,807,141円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,482,590,483円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	11,884,295円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	11,426,028,905円
世界経済インデックスファンド	4,767,149,824円
日本株式インデックス・オープン	3,057,045,957円
ＤＣマイセレクション２５	5,513,810,709円
ＤＣマイセレクション５０	17,745,364,314円
ＤＣマイセレクション７５	18,465,879,281円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	6,035,929,479円
ＤＣマイセレクションＳ２５	3,247,755,784円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,442,498,973円
ＤＣマイセレクションＳ７５	8,039,678,278円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	8,992,918,992円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	131,066,627円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	680,893,327円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	519,669,142円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,696,799,337円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	968,154,158円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,668,401円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	9,733,110円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	15,125,814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）	159,146,848円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,122,651円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	20,132,476円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	75,886,863円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	17,211,066円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	50,507,405円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	615,838,198円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	334,928,128円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,258,517,106円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	31,476,423円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	13,322,230円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	351,674,621円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	202,413,739円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	261,002,017円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	21,853,388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）	448,329,043円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	2,690,339,794円
日本株式ファンド・シリーズ２	1,799,722,904円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,241,824,743円

区分	2023年 7月20日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,805,562,216円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,671,155,657円
分散投資コア戦略ファンドＳ	6,232,800,431円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	564,648,414円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	399,691,267円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,322,566,262円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,301,414円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,580,527円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	50,574,065円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	18,429,154,212円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	285,794,619円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	49,517,723円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	200,933,128円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	34,253,201円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	11,362,657円
グローバル経済コア	211,659,400円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	33,133,453円
Ｍｙ　ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	803,017,852円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	28,119,655円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	980,337,953円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	220,635,518円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	54,634,531円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	49,245,030円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	19,931,023円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	20,703,957円
１０資産分散投資ファンド	93,091,386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）	42,243,013,277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）	546,319,201円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	292,534,209円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	22,074,377円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	665,912,379円
ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用）	45,643,248,671円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,998,999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）	201,184,378円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 7月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)

市場取引	株価指数先物取引 買建	2,972,316,000	－	3,003,805,000	31,489,000
合計		2,972,316,000	－	3,003,805,000	31,489,000

(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。

外国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	277,373,140
コール・ローン	1,762,477,430
国債証券	278,126,919,589
派生商品評価勘定	20,334,557
未収入金	3,371,248
未収利息	1,903,376,701
前払費用	158,667,972
差入委託証拠金	148,079,528
流動資産合計	282,400,600,165
資産合計	282,400,600,165
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	918,950
前受金	10,870,441
未払金	10,351,120
未払解約金	55,363,650
未払利息	3,957
流動負債合計	77,508,118
負債合計	77,508,118
純資産の部	
元本等	
元本	86,781,420,969
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	195,541,671,078
元本等合計	282,323,092,047
純資産合計	282,323,092,047
負債純資産合計	282,400,600,165

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月20日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	2023年 7月20日現在
	移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	86,781,420,969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 3.2533円 (1万口当たり純資産額) (32,533円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2023年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月21日
期首元本額	97,859,127,765円
期中追加設定元本額	7,140,817,821円
期中一部解約元本額	18,218,524,617円
期末元本額	86,781,420,969円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,189,496,896円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	541,135,926円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	368,681,116円

区分	2023年 7月20日現在
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,473,833,451円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	8,225,246円
ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン	8,755,570,324円
世界経済インデックスファンド	17,392,679,051円
ＤＣマイセレクション２５	2,012,344,043円
ＤＣマイセレクション５０	1,786,196,850円
ＤＣマイセレクション７５	1,347,536,935円
ＤＣ外国債券インデックス・オープン	2,265,142,625円
ＤＣマイセレクションＳ２５	1,061,880,081円
ＤＣマイセレクションＳ５０	950,779,040円
ＤＣマイセレクションＳ７５	506,072,165円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	21,705,356円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	100,197,858円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	52,916,321円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	13,462,259,152円
外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	377,525,235円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	989,865円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,033,203円
外国債券インデックス・オープンＶＡ１（適格機関投資家専用）	18,977,261円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	29,649,867円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	55,458,058円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	58,090,610円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	56,828,132円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	967,164,485円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	397,547,660円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,627,034,678円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	55,340,786円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	32,776,514円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	382,700,147円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	145,771,846円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	190,622,109円
ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	665,820,486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）	2,502,081,320円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	652,471,026円
外国債券ファンド・シリーズ１	737,028,963円
分散投資コア戦略ファンドＡ	276,386,697円
分散投資コア戦略ファンドＳ	604,847,674円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	659,294,612円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,309,305,480円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	240,162,528円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	103,313,728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）	1,308,641,883円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	179,428,985円

区分	2023年 7月20日現在
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	348,261,798円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	452,238,291円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	712,709,234円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	7,119,420円
グローバル経済コア	770,265,383円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	20,535,735円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	2,191,575円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	56,600,961円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	67,187,792円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	30,401,943円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	34,495,801円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル債券インデックス（ノーロード）	237,323,801円
１０資産分散投資ファンド	26,157,930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）	12,104,442,828円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	191,993,510円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	610,083,679円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	119,129,458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）	57,335,556円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年 7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	債券先物取引 買建	1,400,299,240	－	1,411,169,681	10,870,441
合計		1,400,299,240	－	1,411,169,681	10,870,441

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023年 7月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,527,080,552	－	1,535,625,718	8,545,166
	アメリカドル	775,059,133	－	776,397,852	1,338,719
	カナダドル	62,081,713	－	62,439,700	357,987
	ユーロ	511,807,938	－	518,914,008	7,106,070
	イギリスポンド	82,932,060	－	82,878,798	△53,262
	オフショア人民元	95,199,708	－	94,995,360	△204,348
合計		1,527,080,552	－	1,535,625,718	8,545,166

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,169,740,107
コール・ローン	2,390,220,769
株式	557,309,223,895
投資信託受益証券	178,601,103
投資証券	11,396,725,396
派生商品評価勘定	356,878,093
未収入金	1
未収配当金	383,715,593
差入委託証拠金	4,977,751,997
流動資産合計	583,162,856,954
資産合計	583,162,856,954
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	130,590
前受金	353,360,392
未払解約金	1,653,668,822
未払利息	5,366
流動負債合計	2,007,165,170
負債合計	2,007,165,170
純資産の部	
元本等	
元本	113,361,330,765
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	467,794,361,019
元本等合計	581,155,691,784
純資産合計	581,155,691,784
負債純資産合計	583,162,856,954

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

	2023年 7月20日現在
4 .収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月20日現在
1 .	計算期間の末日における受益権の総数	113,361,330,765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 5.1266円 (1万口当たり純資産額) (51,266円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7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。

	2023年 7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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2023年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月21日
期首元本額	124,064,922,029円
期中追加設定元本額	7,111,310,777円
期中一部解約元本額	17,814,902,041円
期末元本額	113,361,330,765円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,582,230,032円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,396,334円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	33,981,153,163円
世界経済インデックスファンド	12,029,014,250円
外国株式インデックス・オープン	884,064,474円
ＤＣマイセレクション２５	652,987,154円
ＤＣマイセレクション５０	3,543,984,675円
ＤＣマイセレクション７５	4,370,460,827円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	12,472,411,255円
ＤＣマイセレクションＳ２５	418,896,514円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,885,518,400円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,856,393,192円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	29,442,438円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	153,057,045円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	116,841,267円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,318,475,456円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	989,833,379円

区分	2023年 7月20日現在
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,908,623円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,528,471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）	23,435,133円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	8,866,275円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	35,966,805円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	7,918,160円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	23,236,774円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	192,603,630円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	138,827,090円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,066,005,451円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	72,308,836円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	18,352,619円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	123,433,740円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	40,958,421円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	846,331,991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）	913,377,545円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,125,394,505円
コア投資戦略ファンド（安定型）	110,398,678円
コア投資戦略ファンド（成長型）	275,426,462円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,605,994,046円
分散投資コア戦略ファンドＳ	7,989,687,127円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,421,529,011円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	995,873,433円
コア投資戦略ファンド（切替型）	129,730,185円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	519,236,348円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,142,850円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	128,237,801円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	81,452,152円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	4,213,955,034円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	242,172,091円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	978,274,062円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	165,816,624円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,135,677円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	902,414,022円
グローバル経済コア	537,915,830円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	15,387,987円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	6,330,215円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	111,777,690円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	25,088,180円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	146,900,531円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	134,295,255円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	54,141,200円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	55,700,395円

区分	2023年 7月20日現在
１０資産分散投資ファンド	53,468,754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）	70,308,610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）	23,545,574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）	446,266,918円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,419,761,544円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	107,904,886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）	68,475,569円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	82,943,840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）	69,510,675円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	194,200,383円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	209,372,552円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	208,311,048円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	189,041,134円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	187,171,165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）	86,426,656円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２３－０２（適格機関投資家専用）	134,994,647円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 7月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	11,693,244,411	－	12,046,604,803	353,360,392
合計		11,693,244,411	－	12,046,604,803	353,360,392

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023年 7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)
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	715,543,420	－	718,935,737	3,392,317
	アメリカドル	597,700,000	－	600,617,120	2,917,120
	ユーロ	117,843,420	－	118,318,617	475,197
	売建	191,265,700	－	191,270,906	△5,206
	アメリカドル	191,265,700	－	191,270,906	△5,206
合計		906,809,120	－	910,206,643	3,387,111

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

新興国債券インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,394,407,756
コール・ローン	985,475,092
国債証券	108,930,133,130
未収利息	1,510,073,231
前払費用	167,604,351
流動資産合計	112,987,693,560
資産合計	112,987,693,560
負債の部	
流動負債	
未払解約金	126,301,637
未払利息	2,212
流動負債合計	126,303,849
負債合計	126,303,849
純資産の部	
元本等	
元本	53,809,320,015
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	59,052,069,696
元本等合計	112,861,389,711
純資産合計	112,861,389,711
負債純資産合計	112,987,693,560

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	53,809,320,015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 2.0974円 (1万口当たり純資産額) (20,974円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7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。

	2023年 7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	(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。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2023年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月21日
期首元本額	48,149,126,521円
期中追加設定元本額	8,673,129,909円
期中一部解約元本額	3,012,936,415円
期末元本額	53,809,320,015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	4,829,446,706円
世界経済インデックスファンド	18,004,662,020円
ＤＣ新興国債券インデックス・オープン	5,736,378,493円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	13,947,300,533円
新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	10,594,542円
分散投資コア戦略ファンドＡ	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドＳ	494,740,113円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	682,365,137円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,458,109,703円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	248,918,492円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	107,091,155円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	186,048,020円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	448,952,303円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	582,833,519円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	918,932,477円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	12,200,185円

区分	2023年 7月20日現在
グローバル経済コア	798,694,903円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	92,638,971円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	77,007,134円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	29,349,819円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	29,009,040円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国債券インデックス（ノーロード）	92,672,128円
１０資産分散投資ファンド	42,833,626円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	249,338,059円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	153,804,851円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	9,957,375円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	235,564,617円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	244,878,189円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	243,636,550円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	229,306,395円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	227,038,587円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２３－０２（適格機関投資家専用）	157,879,265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。

新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,405,205,271
コール・ローン	163,570,472
株式	149,575,681,161
投資信託受益証券	460,014,765
投資証券	127,983,177
派生商品評価勘定	90,097,259
未収入金	23,197,696
未収配当金	995,741,757
差入委託証拠金	1,334,933,726
流動資産合計	155,176,425,284
資産合計	155,176,425,284
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,348,578
前受金	86,060,089
未払金	520,809
未払解約金	14,824,127

	2023年 7月20日現在
項目	金額（円）
未払利息	367
流動負債合計	104,753,970
負債合計	104,753,970
純資産の部	
元本等	
元本	40,261,256,266
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	114,810,415,048
元本等合計	155,071,671,314
純資産合計	155,071,671,314
負債純資産合計	155,176,425,284

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引

	2023年 7月20日現在
	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	40,261,256,266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 3.8516円 (1万口当たり純資産額) (38,516円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7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。

	2023年 7月20日現在
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2023年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月21日
期首元本額	33,154,306,941円
期中追加設定元本額	10,081,804,174円
期中一部解約元本額	2,974,854,849円
期末元本額	40,261,256,266円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン	7,765,360,963円
世界経済インデックスファンド	9,199,935,387円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	5,945,960,578円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	7,101,688,164円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	105,811,931円
コア投資戦略ファンド（安定型）	48,466,827円

区分	2023年 7月20日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	120,923,879円
分散投資コア戦略ファンドＡ	309,401,097円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,517,431,406円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,091,024,373円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	767,332,047円
コア投資戦略ファンド（切替型）	56,957,230円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	395,592,101円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,358,597円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	96,902,567円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	35,711,445円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	1,854,690,498円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	229,231,508円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	932,504,921円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	158,596,051円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,226,238円
グローバル経済コア	405,942,173円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	170,177,289円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	49,096,565円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	11,025,606円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	94,089,304円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	85,627,427円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	34,360,275円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	35,024,019円
１０資産分散投資ファンド	13,164,952円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,375,613,365円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	101,903,956円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	78,226,427円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	10,242,411円
ＦＯＦｓ用　新興国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	38,654,689円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 7月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,751,957,667	－	4,838,017,756	86,060,089
合計		4,751,957,667	－	4,838,017,756	86,060,089

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023年 7月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	143,972,042	－	144,680,160	708,118
	アメリカドル	143,972,042	－	144,680,160	708,118
	売建	2,192,042	－	2,211,568	△19,526
	ブラジルレアル	2,192,042	－	2,211,568	△19,526
合計		146,164,084	－	146,891,728	688,592

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

2【ファンドの現況】

【ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）】

【純資産額計算書】

（2023年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	17,713,270,720円
Ⅱ　負債総額	20,308,585円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	17,692,962,135円
Ⅳ　発行済口数	7,562,201,466口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3397円
（1万口当たり純資産額）	（23,397円）

（参考）

国内債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	660,626,263,905円
Ⅱ　負債総額	15,018,155,399円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	645,608,108,506円
Ⅳ　発行済口数	481,897,857,642口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3397円
（1万口当たり純資産額）	（13,397円）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	575,668,922,016円
Ⅱ　負債総額	278,589,085円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	575,390,332,931円
Ⅳ　発行済口数	242,767,472,998口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3701円
（1万口当たり純資産額）	（23,701円）

外国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	**289,833,283,229円**
Ⅱ　負債総額	**85,737,227円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**289,747,546,002円**
Ⅳ　発行済口数	**87,139,172,738口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**3.3251円**
（1万口当たり純資産額）	**（33,251円）**

外国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	**602,926,128,225円**
Ⅱ　負債総額	**2,822,200,916円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**600,103,927,309円**
Ⅳ　発行済口数	**113,704,942,556口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**5.2777円**
（1万口当たり純資産額）	**（52,777円）**

新興国債券インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	**116,820,799,303円**
Ⅱ　負債総額	**4,188,393円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**116,816,610,910円**
Ⅳ　発行済口数	**54,525,865,164口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.1424円**
（1万口当たり純資産額）	**（21,424円）**

新興国株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 8月31日現在）

Ⅰ　資産総額	163,842,215,024円
Ⅱ　負債総額	3,703,482,508円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	160,138,732,516円
Ⅳ　発行済口数	40,880,680,444口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.9172円
（1万口当たり純資産額）	（39,172円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

則として取得申込者とします。）に支払います。

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2023年 8月31日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

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

委託会社の機構は2023年10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。

2023年8月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	531	14,695,810
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	204,896
単位型公社債投資信託	50	169,396
合計	648	15,070,102

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。

なお、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、当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	前事業年度 （2022年3月31日）		当事業年度 （2023年3月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		21,675		23,067
金銭の信託		14,913		14,693
前払費用		166		198
未収委託者報酬		9,067		9,147
未収運用受託報酬		6,252		5,815
未収収益		179		176
短期差入証拠金		2,528		3,541
その他		2,363		1,566
流動資産合計		57,146		58,207
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	289	※1	255
器具備品	※1	687	※1	560
有形固定資産合計		976		816
無形固定資産				
ソフトウェア		6,292		7,203
その他		31		40
無形固定資産合計		6,324		7,244
投資その他の資産				
投資有価証券		6,607		4,063
関係会社株式		5,636		5,636
繰延税金資産		907		1,181
その他		31		31
投資その他の資産合計		13,182		10,911
固定資産合計		20,482		18,972
資産合計		77,629		77,179

（単位：百万円）

	前事業年度 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
負債の部		

流動負債		
預り金	47	49
未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	△509	△510
評価・換算差額等合計	431	△460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度	当事業年度

	（自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	（自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918
その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	―	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	―
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
営業外収益		

受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	－	565
その他	8	11
営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	－
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	－
特別損失合計	120	－
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	△465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797

当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	―	―	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

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

当事業年度（自　2022年4月1日　至　2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			△2,641	△2,641	△2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	―	―	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	△509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				△2,641

当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△891	△0	△891	△891
当期変動額合計	△891	△0	△891	1,915
当期末残高	49	△510	△460	66,134

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

２．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

３．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

４．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

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

５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

６．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

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

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理

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

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

７．収益及び費用の計上基準

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

（1）投資信託委託業務

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

（2）投資一任業務

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

（3）投資助言業務

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

（4）成功報酬

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

８．ヘッジ会計の会計処理

（1）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

（2）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

（3）ヘッジ方針

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

（4）ヘッジ有効性評価の方法

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

９．グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

（会計方針の変更）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

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

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（表示方法の変更）

（貸借対照表関係）

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

（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 （2022年3月31日）		当事業年度 （2023年3月31日）	
建　　物	146	百万円	184	百万円
器具備品	535	〃	681	〃
計	681	〃	866	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

１．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	－	－	3,000

２．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

３.配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
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

（2）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
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

当事業年度（自 2022年4月1日　至 2023年3月31日）

１．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	－	－	3,000

２．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

３.配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当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

2023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
2023年6月22日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針８．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払い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。

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

２.金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31 号 2021年6月17日）第24-16 項を適用した組合出資

金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（1）*2、*3及び（注2）参照）。

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

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

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

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

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

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2022年3月31日）

区　分	貸借対照表計上額（百万円）（*1、*2）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	－	196	－	196
資産計	－	196	－	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	－	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	－	(71)	－	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	－	(1,485)

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(*2) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

(*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

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

当事業年度（2023年3月31日）

区　分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	－	13,733
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	－	3,844	－	3,844
資産計	1,029	16,547	－	17,577
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	(10)	(48)	－	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	－	(88)	－	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	－	(147)

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額は960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。

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

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

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

デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

区分	前事業年度 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

（注3） 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2022年3月31日）　（単位:百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	－	－	－
未収委託者報酬	9,067	－	－	－
未収運用受託報酬	6,252	－	－	－
投資有価証券 投資信託	－	108	1,712	0

当事業年度（2023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	23,067	－	－	－
未収委託者報酬	9,147	－	－	－
未収運用受託報酬	5,815	－	－	－
投資有価証券 投資信託	－	594	2,144	38

（有価証券関係）

１．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位:百万円）

区分	前事業年度 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
子会社株式	5,636	5,636

２．その他有価証券

前事業年度（2022年3月31日） **（単位:百万円）**

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	△126
小計	1,585	1,711	△126
合計	6,474	5,115	1,358

当事業年度（2023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	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	△292
小計	2,857	3,150	△292
合計	3,844	3,772	71

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位:百万円）

区分	前事業年度 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

３．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日） **（単位:百万円）**

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

当事業年度（自　2022年4月1日　至　2023年3月31日）　（単位:百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

（デリバティブ取引関係）

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

前事業年度（2022年3月31日）

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	5,498	－	△54	△54
	英ポンド	277	－	△1	△1
	カナダドル	111	－	△1	△1
	スイスフラン	139	－	△2	△2
	香港ドル	190	－	△1	△1
	ユーロ	676	－	△18	△18
	買建				
	ユーロ	21	－	0	0
合計		6,915	－	△80	△80

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	5,923	－	△21	△21
	英ポンド	256	－	△6	△6
	カナダドル	109	－	△1	△1
	スイスフラン	163	－	△2	△2
	香港ドル	202	－	△0	△0
	ユーロ	651	－	△19	△19
	買建				
	米ドル	152	－	3	3
合計		7,458	－	△48	△48

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

前事業年度（2022年3月31日）

種類		契約額等（百万円）	契約額等のうち1年超（百万円）	時価（百万円）	評価損益（百万円）
市場取引	株価指数先物取引				
	売建	17,197	－	△1,333	△1,333
合計		17,197	－	△1,333	△1,333

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

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	12,195	－	△9	△9
	債券先物取引 売建	182	－	△0	△0
合計		12,378	－	△10	△10

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 （百万円）	契約額等の うち1年超 （百万円）	時価 （百万円）
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 関係会社株式	4,422	－	△43
	英ポンド		3,297	－	△21
	スイスフラン		79	－	△1
	香港ドル		119	－	△1
	ユーロ		125	－	△3
	人民元		13	－	△0
合計			8,057	－	△71

当事業年度（2023年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 （百万円）	契約額等の うち1年超 （百万円）	時価 （百万円）
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 関係会社株式	1,729	－	△6
	英ポンド		3,228	－	△81
	スイスフラン		20	－	△0
	香港ドル		83	－	△0
	ユーロ		21	－	△0
合計			5,082	－	△88

（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。

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　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
退職給付債務の期首残高	626	820

勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	―	6
退職給付の支払額	△81	△57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	―
その他	18	―
退職給付債務の期末残高	820	911

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表
該当事項はありません。

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

（単位：百万円）

	前事業年度 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	―	△6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

（4）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	―
その他	18	―
確定給付制度に係る退職給付費用	274	142

（5）年金資産に関する事項
該当事項はありません。

（6）数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
割引率	0.4%	0.4%

3．確定拠出制度
当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度100百万円、当事業年度109百万円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （2022年3月31日）		当事業年度 （2023年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	〃	187	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	〃	277	〃
税務上の収益認識差額	74	〃	―	〃
税務上の費用認識差額	439		412	
繰延ヘッジ損益	224	〃	225	〃

その他	76	〃	75	〃
繰延税金資産 合計	1,357	〃	1,236	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△415	〃	△21	〃
その他	△34	〃	△32	〃
繰延税金負債 合計	△450	〃	△54	〃
繰延税金資産の純額	907	〃	1,181	〃

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。

３．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号　2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

１．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

２．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針７．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

３．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

［関連情報］

１．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

３．主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

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

当事業年度（自 2022年4月1日　至 2023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	9,887百万円

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

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

当事業年度（自 2022年4月1日　至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	―	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

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

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記
（1）親会社情報
前事業年度（2022年3月31日）
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2023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　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度（自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
1株当たり純資産額	21,406,512円22銭	22,044,962円63銭
1株当たり当期純利益金額	2,162,405円20銭	1,816,227円49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　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度（自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

(1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2023年10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

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2023年3月末日現在）

③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円）（2023年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

２【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

３【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2023年3月末日現在）
④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(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やＳＮＳのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）、名称や利用上の注意事項等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

2023年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　三　上　和　彦
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　藤　澤　　孝

監査意見
　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年４月１日から2023年３月31日までの第37期事業年度の財務諸表、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2023年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
　その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。
　当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年4月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　　締　　役　　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　松崎雅則

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2022年1月21日から2023年1月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2023年1月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年10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

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　松崎雅則

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2023年1月21日から2023年7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、DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）の2023年7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（2023年1月21日から2023年7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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

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

利害関係

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

以　上

（注）１．上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。