【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年10月10日提出
【計算期間】	第5期(自 2022年7月12日至 2023年7月10日)
【ファンド名】	コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）
【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
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

＜基本的性格＞

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

す。

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

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

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

［投資対象地域による区分］

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

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

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

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

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

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

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

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

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

［独立した区分］

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

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

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

［補足分類］

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

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

［決算頻度による属性区分］

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

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

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

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

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

いう。

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

(7)その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］

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

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

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

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

(5)アジア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(6)オセアニア…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(7)中南米…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(8)アフリカ…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(9)中近東(中東)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(10)エマージング…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資形態による属性区分］

(1)ファミリーファンド…目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

(2)ファンド・オブ・ファンズ…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

［為替ヘッジによる属性区分］

(1)為替ヘッジあり…目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

(2)為替ヘッジなし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

［インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分］

(1)日経225

(2)TOPIX

(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

［特殊型］

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

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

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

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

◆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. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

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

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

2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

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

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

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

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

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

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

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

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

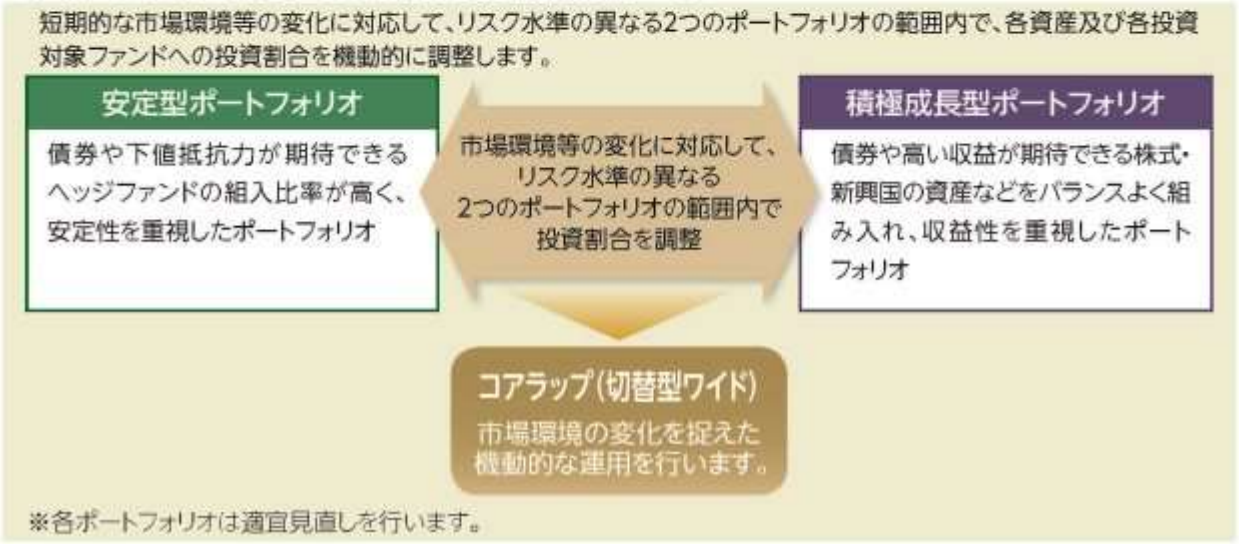
●「株式」、「リート」、「コモディティ」を実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90%未満とします。

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

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

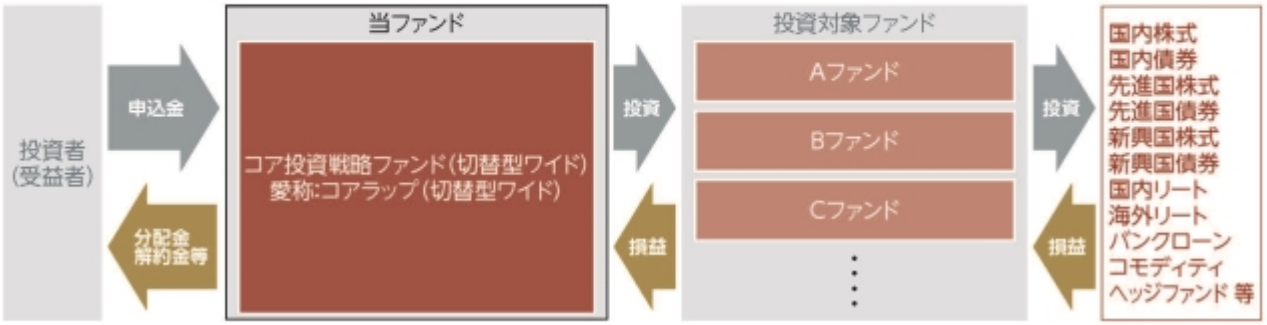
※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

<(*)「コアラップ（切替型ワイド）」の切替機能のイメージ>



ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



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

ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

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

主な投資制限

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

〈ご参考情報〉

バンクローン

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

コモディティ

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

ヘッジファンド

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

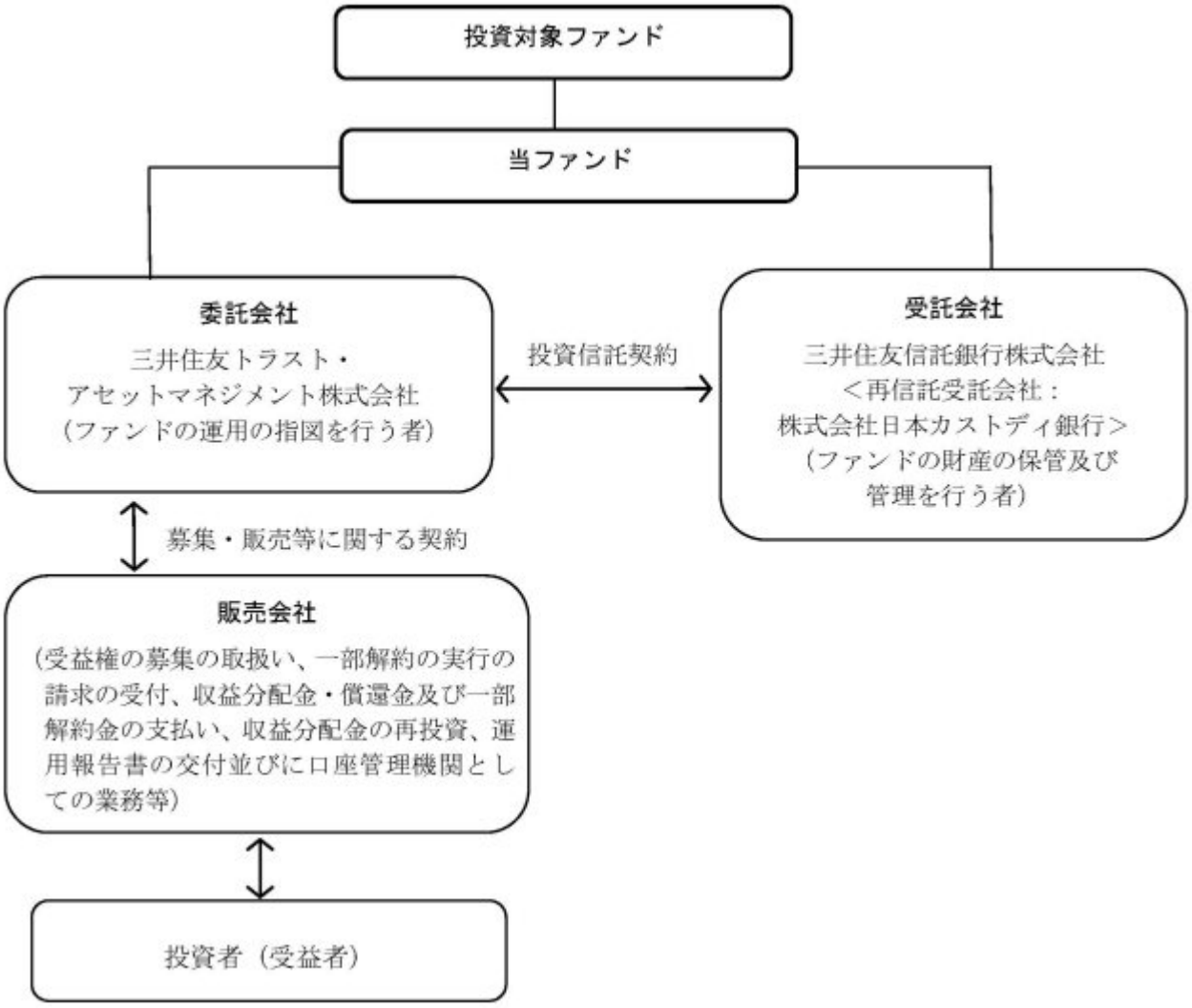
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2018年10月26日　　当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2023年 7月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①基本方針

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

②投資対象

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

③投資態度

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

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

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

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

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

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

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

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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

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

（2）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券

2. 金銭債権

3. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

②有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1.コマーシャル・ペーパー及び短期社債等

2.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの

3.国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）

4.外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

③金融商品の指図範囲

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

1.預金

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

3.コール・ローン

4.手形割引市場において売買される手形

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要

・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2023年 7月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

1.国内株式インデックス マザーファンド

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

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は、行いません。 ③新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。 ⑤同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1 項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

①TOPIX（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が有する。

②ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みＴＯＰＩＸに係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。

③ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の配当込みＴＯＰＩＸの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。

④ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、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、責任を負わない。

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではない。

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

⑦ＪＰＸは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みＴＯＰＩＸの指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。

⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

2.日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	**三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社**
運用の基本方針	**この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。**
主要投資対象	**わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。**
投資態度	**①主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）（※）に連動する投資成果を目指します。** **②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。** **③株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。** **④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。**

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）
決算日	年1回：4月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年4月23日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

当ファンドは、MSCI Inc.（以下「MSCI」）、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者（総称して「MSCI当事者」）が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定的な投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使

用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害（逸失利益を含む）について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

3.国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	**日興アセットマネジメント株式会社**
運用の基本方針	**この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（※））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。**
主要投資対象	**アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。**
投資態度	**主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。**

主な投資制限	①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行ないません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。 ⑤デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜　0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

4.日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	①主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。 ②信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。 ③事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。 ④投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。 ⑤ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。 ⑥市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ③新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ⑦株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。 ⑧デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑨一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。

決算日	年2回：6月および12月の15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。 ②分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。 ③収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜　0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014年6月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

5.FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）

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

受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

6.国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債
投資態度	①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

主な投資制限	①同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は、行いません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

7.日本債券ツイン戦略マザーファンド

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

投資態度	①わが国の公社債に投資しつつ、国債先物取引及び国債に係る選択権付債券売買取引を行うことでNOMURA-BPI総合（※）を上回る投資成果を目指します。 ②ポートフォリオは、クレジット戦略に基づいて事業債を中心とした銘柄選択を行い、金利戦略に基づいてデュレーション等を調整しながら構築します。なお、金利戦略においては、国債先物取引や国債に係る選択権付債券売買取引を活用します。 ③公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：2月21日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI総合」とは、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。
同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属しま

す。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

運用会社	**マニュライフ・インベストメント・マネジメント株式会社**
運用の基本方針	**主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。**
主要投資対象	**主としてマニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど短期金融商品等に直接投資する場合があります。**
投資態度	**①マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。 ②NOMURA-BPI総合（※）を参考指数として、ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。 ③マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ④大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。**
主な投資制限	**①債券への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③有価証券先物取引等の直接利用は行いません。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券を除く）への投資は行いません。 ⑤一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑥デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 ⑦同一銘柄の株式、転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑧信用取引、空売り、有価証券の借入れは行いません。**
ベンチマーク	**該当事項はありません。**
決算日	**年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）**

収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。 ③留保益（収益分配に充てず信託財産内に留保した利益）については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。
信託報酬	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り　　信託報酬 0.5%未満の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.264% （税抜　0.24%） 0.5%以上１%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.297% （税抜　0.27%） １%以上の場合 ・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.33% （税抜　0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

9.明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

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

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

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

※「NOMURA-BPI総合」は、日本国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社の知的財産です。野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。

10.ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）

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

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

主な投資制限	①株式への投資は転換社債の転換及び新株予約権の行使による取得に限るものとし、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。なお、ここでいう新株予約権とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権をいいます。 ②同一銘柄の転換社債及び転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑤外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。 ⑥デリバティブ取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	NOMURA-BPI（総合）指数
決算日	年1回：6月10日（休業日の場合は翌営業日。第1期決算日は2024年6月10日）
収益の分配	・分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。ただし、ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます。）等の全額とします。 ・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。 ・純資産総額100億円以下の部分　年率0.275%（税抜　0.25%） ・純資産総額100億円超の部分　　年率0.253%（税抜　0.23%）
信託財産留保額	取得申込受付日及び解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.03%の率を乗じて得た額
設定日	2023年4月5日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI（総合）指数」とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

11.ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド(適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「年金日本債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債へ投資することにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として次のような運用を行います。 ・NOMURA-BPI総合指数（※）をベンチマークとし、デュレーション・コントロールを重視したアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ②株式への実質投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合指数
決算日	年1回：1月27日（休業日の場合は翌営業日）

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

※「NOMURA-BPI総合指数」とは野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社が公表する日本の債券市場の動向を的確に表すための市場指数です。日本の債券市場のベンチマークに多く利用されています。NOMURA-BPI総合指数に関する一切の知的財産権その他の一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属しております。また、同社は、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

12.外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(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。
主要投資対象	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

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。**

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCIコクサイ・インデックス」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。

13.外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式（預託証券（DR）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目指します。 ②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：6月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

当ファンドは、MSCI Inc.(以下「MSCI」）、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」）が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。

MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定的な投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害（逸失利益を含む）について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

14.グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）

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

主な投資制限	①株式の実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 ③新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑦デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。 ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年１回：4月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合には委託者の判断で分配を行わないことがあります。 ③収益の分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.814%（税抜0.74%） マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬は、委託者との間で別に定める取決めに基づく金額を、委託者から支払うものとします。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

15.ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社

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

主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約券証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑤同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑧為替予約の利用及びデリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑨一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)
決算日	年1回：9月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則、毎決算時に分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。 ※分配金は、決算日から起算して５営業日以内に支払われます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.671%（税抜　0.61%） このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年9月24日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式 マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式等に投資を行う場合があります。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式 マザーファンドへの投資を通じて、実質的に日本を除く世界各国の株式等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長をめざします。 ②上記マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位に保ちます。 ③MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）をベンチマークとします。 ④実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑤資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として日本を除く世界各国の企業が発行する株式等を中心に投資を行います。 ②徹底的なリサーチと行動ファイナンスのアプローチに基づき、市場の懸念によりファンダメンタルズよりも割安に評価されている銘柄を選定します。 ③MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）をベンチマークとします。 ④運用にあたっては、Sanders Capital，LLCに運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の指図に関する権限を除きます。）を委託します。 ⑤外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑥資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）及び外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的並びに価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑩一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	・分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7381%（税抜　0.671%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月7日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI KOKUSAI Index（配当込・税引後）」は、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く主

要先進国の株式により構成されています。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託者が独自に円換算したものです。

17.世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）

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

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

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

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

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

19.世界債券総合インデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（※）（以下「ベンチマーク」ということがあります。）を構成する通貨建ての債券等（ベンチマークを構成する債券以外の証券等や上場投資信託証券を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてベンチマークを構成する通貨建ての債券等に投資し、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。 ②債券等への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：4月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.1%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2023年4月21日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

運用会社	フィデリティ投信株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行ないます。
主要投資対象	フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。
投資態度	①フィデリティ・外国債券・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、世界各国の投資適格債券（除く日本円）を主要な投資対象とし、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的として運用を行ないます。 ②実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行ないません。 ③資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。
主な投資制限	①株式への実質的な直接投資は、原則として行ないません。ただし、転換社債の転換ならびに新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものを除きます。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月30日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。 ①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行なうものではありません。 ③留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.451%（税抜0.41%）
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2021年7月16日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

21.新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（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。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）
投資態度	①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（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者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。 ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。

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

※「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「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。

22.ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）

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

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

主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ③同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑥為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	毎年10月9日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則、毎決算時に分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。 ＊分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.33%（税抜　0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

23.J-REITインデックス マザーファンド

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

主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	①わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）

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

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

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

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

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

④ＪＰＸは、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

24.グローバルREITインデックス マザーファンド

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

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

※「S&P先進国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。
S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's(R)及びS&P(R)は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones(R)はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow

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

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

25.グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

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

投資態度	①ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。 ②米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。 ③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ④投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。 ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 上記④は、2023年11月18日付で以下の内容に変更を予定しています。 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、金利に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。

主な投資制限	①株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

26.ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 ＜別に定める金現物に投資する上場投資信託証券＞（2023年7月31日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
投資態度	①主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 ②投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 ③投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④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、デリバティブ取引等を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	LBMA金価格（円ヘッジベース）（※）（2023年7月31日現在） ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

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

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

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

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

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

投資態度	①マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」（以下「Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンド」※といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。 ※Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。 ②円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

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

29.米国株式LSマザーファンド

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

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

30.コモディティLSアルファ・マザーファンド

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

投資態度	①円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。 ②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

31.米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

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

主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年10月6日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

32.ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

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

投資態度	①主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。 ②債券先物取引及び為替予約取引等は、原則として定量的手法に基づいた複数の運用戦略を組み合わせることで行います。 ③資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑤為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

運用会社	野村アセットマネジメント株式会社

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

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

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

34.ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）

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

投資態度	①ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。 ②ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 ③資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主に、日本の公社債に投資するとともに、主要先進国通貨を中心とした為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。 ②モデルによる定量分析とポートフォリオマネージャーによる定性分析を組み合わせた独自のアプローチにより、ポートフォリオを構築します。 ③リスク管理を運用プロセスに組み込み、ポジション・リスクの分散化を図ります。 ④資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑤運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるウエスタン・アセット・マネジメント株式会社及びウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国）に委託します。
主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。 ③同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10％以内とします。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以内とします。 ⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑥為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10％、合計で20％以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.418％（税抜　0.38％） このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05％を上限）をファンドから支弁します。 投資顧問会社の報酬は、委託者が収受する委託者報酬から支弁されます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年4月12日
信託期間	原則として無期限

受託会社	三井住友信託銀行株式会社

35.MA Hedge Fund Strategies Limited

運用会社	UBS O'Connor LLC
運用の基本方針	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。
主要投資対象	主として世界各国（日本を含みます。）の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。
投資態度	①公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。 ②ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。 ③為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。
主な投資制限	①投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 ②投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。 ③一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 ④流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の15%以下とします。 ⑤外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑥一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑦投資信託証券への投資は行いません。 ⑧デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月31日（決算日が休日の場合は、前営業日となります。）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	運用報酬：年率0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日

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

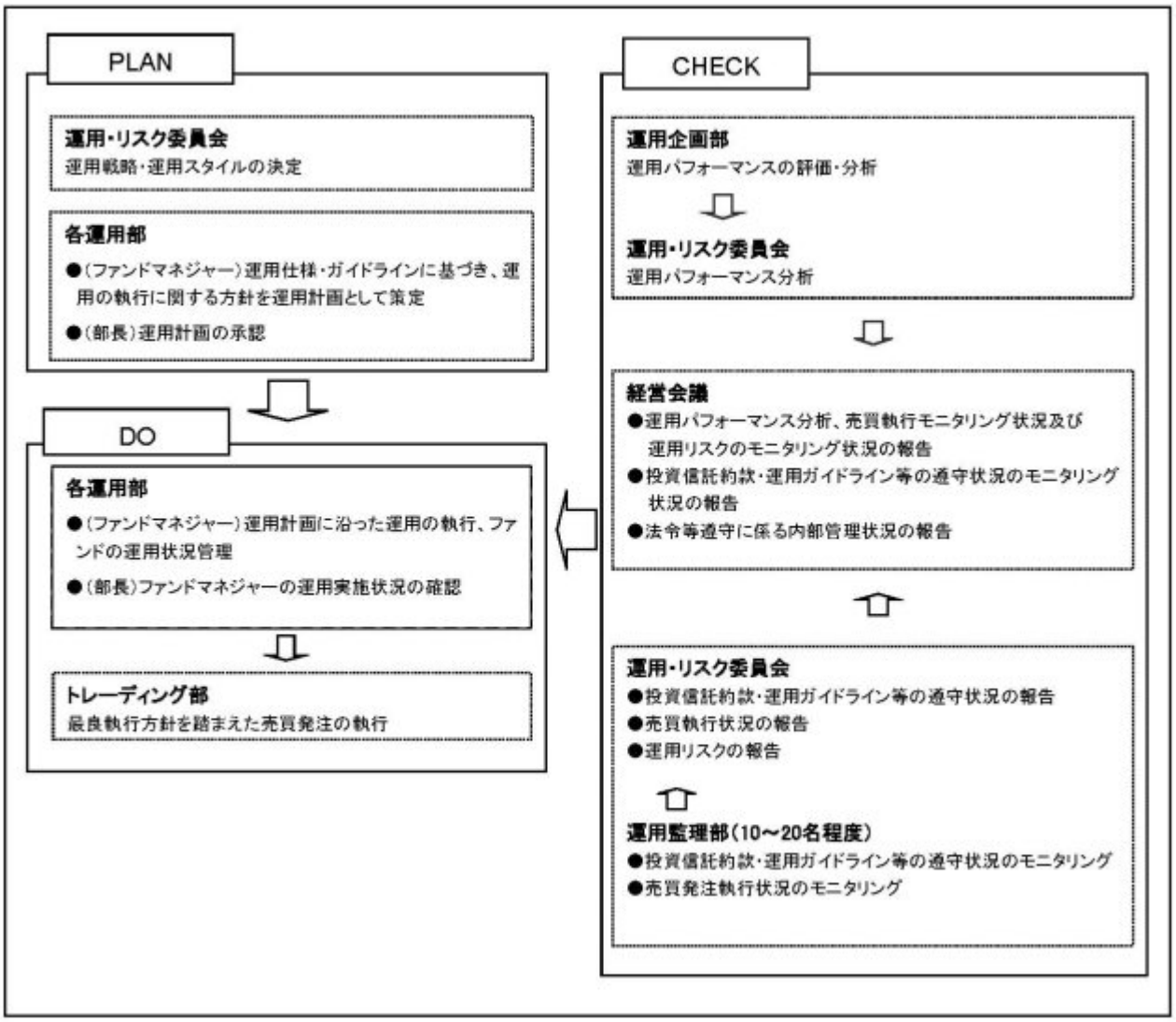
36.MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（4）【分配方針】

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（5）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ヘ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

チ．外国為替予約取引の指図

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

リ．資金の借入れ

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

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

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

＜その他の投資制限＞

イ．当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク

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

②金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固

定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

③リートの価格変動リスク

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

④商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

⑤為替変動リスク

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

⑥信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受ける可能性があり、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスクがより高いものになると想定されます。

⑦流動性リスク

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

⑧カントリーリスク

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

⑨資産等の選定・配分に係るリスク

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

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

⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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

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

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

⑪仕組み債券に係るリスク

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

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

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

⑫ブローカーの信用リスク

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

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

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

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

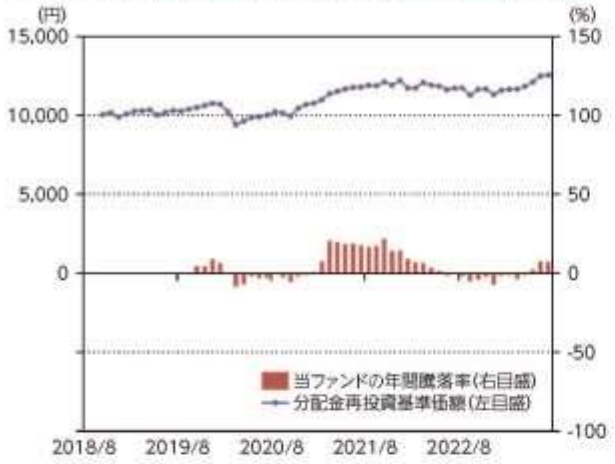
(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

*当ファンドについては2019年10月～2023年7月の3年10ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2018年8月～2023年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

各資産クラスの指数について

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

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

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

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

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

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

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

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

（２）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞
ありません。
＜信託財産留保額＞
当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する投資対象ファンドの解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率1.518%（税抜　1.38%）を乗じて得た額とします（信託報酬 ＝ 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率　0.968%　　（税抜　0.88%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率　0.495%　　（税抜　0.45%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率　0.055%　　（税抜　0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

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

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

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

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
⑤ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用（※）は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
⑥これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。
※上記における役務提供の内容は以下の通りです。
組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。
①個人の受益者に対する課税
イ．収益分配金に対する課税
収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

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

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合
少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度です。
NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となりますが、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。
ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。
また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。
なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について
イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。
（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について
追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本

払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※上記は、2023年 7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)ファンドの経費率(投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。)
直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの経費率は以下の通りです。

経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.71%	1.53%	0.18%

※対象期間は2022年7月12日～2023年7月10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。
※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。
※投資先ファンドにかかる運用管理費用は、その他費用に含まれています。なお、運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれていません。
※ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。
※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7月31日現在の状況について記載してあります。

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	6,290,938,390	35.02
投資証券	ルクセンブルク	890,028,959	4.95
	ケイマン	285,557,282	1.59
	ジャージー	147,164,540	0.82
	小計	1,322,750,781	7.36
親投資信託受益証券	日本	9,290,851,481	51.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,058,490,864	5.89
合計(純資産総額)		17,963,031,516	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、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス　マザーファンド	980,337,953	2.2798	2,235,000,209	2.3600	2,313,597,569	12.88
日本	親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	672,228,737	2.1028	1,413,596,917	2.1352	1,435,342,799	7.99
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	969,067,164	1.2441	1,205,663,013	1.2603	1,221,315,346	6.80
日本	親投資信託受益証券	グローバルＲＥＩＴインデックスマザーファンド	345,064,516	2.5486	879,431,425	2.5906	893,924,135	4.98
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	455,024,284	1.3478	613,281,729	1.3785	627,250,975	3.49
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	240,656,609	2.5035	602,483,820	2.5786	620,557,131	3.45
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	116,500,119	5.0154	584,305,649	5.1873	604,321,067	3.36
日本	投資信託受益証券	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	460,382,459	1.2713	585,284,220	1.3092	602,732,715	3.36
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	320,651.111	1,800	577,171,999	1,875	601,220,833	3.35
日本	投資信託受益証券	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	423,499,014	1.383	585,699,136	1.3912	589,171,828	3.28
日本	投資信託受益証券	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	302,364,573	1.9379	585,952,306	1.925	582,051,803	3.24
日本	投資信託受益証券	世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	503,619,253	1.1591	583,745,076	1.1477	578,003,816	3.22
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	301,319,198	1.441	434,200,964	1.472	443,541,859	2.47
日本	親投資信託受益証券	米国株式ＬＳマザーファンド	399,064,145	1.0849	432,944,690	1.0934	436,336,736	2.43
日本	親投資信託受益証券	世界債券総合インデックスマザーファンド	379,636,686	1.0442	396,416,627	1.0476	397,707,392	2.21
日本	親投資信託受益証券	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	324,710,324	1.2349	400,984,779	1.2246	397,640,262	2.21
日本	投資信託受益証券	ノムラＦＯＦｓ用　日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	431,473,873	0.8866	382,544,735	0.8852	381,940,672	2.13
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	606,506,584	0.5779	350,528,196	0.5988	363,176,142	2.02
日本	投資信託受益証券	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	357,141,978	0.967	345,362,176	0.9617	343,463,440	1.91
日本	投資信託受益証券	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	335,465,127	1.0199	342,140,883	1.0174	341,302,220	1.90
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	26,771.785	10,635.7	284,736,674	10,787.78	288,808,126	1.61
日本	投資信託受益証券	明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	301,388,005	0.9649	290,837,949	0.9572	288,488,598	1.61
日本	親投資信託受益証券	日本債券ツイン戦略マザーファンド	304,687,311	0.9511	289,805,413	0.9432	287,381,071	1.60
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	29,026	9,827.33	285,248,334	9,837.98	285,557,282	1.59
日本	投資信託受益証券	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	310,556,384	0.8943	277,759,310	0.888	275,774,068	1.54

日本	親投資信託受益証券	日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	177,935,243	1.2274	218,397,717	1.2725	226,422,596	1.26
日本	親投資信託受益証券	外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	155,144,883	1.3139	203,844,861	1.3608	211,121,156	1.18
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	51,001,497	3.7850	193,045,557	3.9733	202,644,248	1.13
日本	投資信託受益証券	ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	144,073,662	1.2811	184,572,768	1.2698	182,944,736	1.02
日本	投資信託受益証券	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	169,475,342	1.0897	184,677,280	1.0722	181,711,461	1.01

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	35.02
投資証券	7.36
親投資信託受益証券	51.72
合計	94.11

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末　(2019年 7月10日)	8,980,843,249	8,980,843,249	10,284	10,284
第2期計算期間末　(2020年 7月10日)	11,787,026,676	11,787,026,676	9,951	9,951
第3期計算期間末　(2021年 7月12日)	12,831,760,694	12,831,760,694	11,807	11,807
第4期計算期間末　(2022年 7月11日)	15,193,556,526	15,193,556,526	11,599	11,599
第5期計算期間末　(2023年 7月10日)	17,712,843,519	17,712,843,519	12,391	12,391
2022年 7月末日	15,498,730,434	—	11,718	—
8月末日	15,813,005,954	—	11,724	—
9月末日	15,432,012,838	—	11,288	—
10月末日	16,061,532,073	—	11,640	—

11月末日	16,182,826,575	—	11,672	—
12月末日	15,791,031,772	—	11,324	—
2023年 1月末日	16,280,756,545	—	11,582	—
2月末日	16,431,434,244	—	11,648	—
3月末日	16,506,004,760	—	11,669	—
4月末日	16,846,010,202	—	11,829	—
5月末日	17,203,258,519	—	12,096	—
6月末日	17,844,826,397	—	12,495	—
7月末日	17,963,031,516	—	12,557	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2018年10月26日～2019年 7月10日	0
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0
第5期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第1期計算期間	2018年10月26日～2019年 7月10日	2.8
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	△3.2
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	18.7
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	△1.8
第5期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	6.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2018年10月26日～2019年 7月10日	9,362,328,441	629,077,416	8,733,251,025
第2期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	6,207,727,771	3,096,276,176	11,844,702,620
第3期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	1,926,137,065	2,903,204,631	10,867,635,054
第4期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	3,838,843,288	1,607,580,740	13,098,897,602
第5期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	2,620,317,864	1,424,480,125	14,294,735,341

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。
(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	566,651,393,010	99.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	4,655,009,746	0.81
合計(純資産総額)		571,306,402,756	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	4,491,110,000	0.79

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,419,900	1,930.26	18,182,857,332	2,386.00	22,475,881,400	3.93
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,213,500	13,275.38	16,109,676,307	13,315.00	16,157,752,500	2.83
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	10,581,400	928.65	9,826,511,273	1,146.00	12,126,284,400	2.12
日本	株式	キーエンス	電気機器	171,600	68,642.28	11,779,016,359	63,760.00	10,941,216,000	1.92
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	55,116,600	162.74	8,969,790,746	162.90	8,978,494,140	1.57
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,201,000	5,652.07	6,788,136,070	6,694.00	8,039,494,000	1.41
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,106,600	5,912.85	6,543,161,438	7,265.00	8,039,449,000	1.41
日本	株式	日立製作所	電気機器	842,600	8,132.81	6,852,710,238	9,298.00	7,834,494,800	1.37
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	363,100	19,720.84	7,160,638,133	21,245.00	7,714,059,500	1.35

日本	株式	三井物産	卸売業	1,288,100	4,638.43	5,974,773,882	5,541.00	7,137,362,100	1.25
日本	株式	任天堂	その他製品	1,083,100	5,911.30	6,402,533,559	6,450.00	6,985,995,000	1.22
日本	株式	信越化学工業	化学	1,428,400	4,403.90	6,290,535,016	4,679.00	6,683,483,600	1.17
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,522,900	4,538.11	6,911,088,124	4,341.00	6,610,908,900	1.16
日本	株式	第一三共	医薬品	1,498,900	4,543.42	6,810,132,737	4,347.00	6,515,718,300	1.14
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,305,700	4,441.71	5,799,548,083	4,933.00	6,441,018,100	1.13
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,118,400	4,948.06	5,533,920,921	5,750.00	6,430,800,000	1.13
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,394,500	4,026.98	5,615,631,461	4,513.00	6,293,378,500	1.10
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	848,700	5,548.83	4,709,298,650	7,242.00	6,146,285,400	1.08
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	363,500	17,161.08	6,238,052,775	16,530.00	6,008,655,000	1.05
日本	株式	ダイキン工業	機械	206,800	26,760.62	5,534,096,956	28,690.00	5,933,092,000	1.04
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,443,500	2,075.76	5,072,123,650	2,404.00	5,874,174,000	1.03
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,329,500	4,356.87	5,792,468,644	4,187.00	5,566,616,500	0.97
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,670,100	3,111.69	5,196,846,802	3,259.00	5,442,855,900	0.95
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	933,300	5,375.18	5,016,664,396	5,450.00	5,086,485,000	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,765,800	1,510.65	4,178,173,914	1,578.00	4,364,432,400	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	520,300	8,256.93	4,296,083,838	8,325.00	4,331,497,500	0.76
日本	株式	ＳＭＣ	機械	56,200	74,566.24	4,190,623,002	74,150.00	4,167,230,000	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	625,600	6,148.31	3,846,382,915	5,893.00	3,686,660,800	0.65
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,790,700	1,833.20	3,282,721,083	2,051.00	3,672,725,700	0.64
日本	株式	ファナック	電気機器	836,600	4,760.78	3,982,869,824	4,348.00	3,637,536,800	0.64

(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	0.08
		鉱業	0.33
		建設業	2.03
		食料品	3.23
		繊維製品	0.43
		パルプ・紙	0.17
		化学	5.93
		医薬品	4.91
		石油・石炭製品	0.43
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.94
		非鉄金属	0.68

		金属製品	0.51
		機械	5.47
		電気機器	17.86
		輸送用機器	8.03
		精密機器	2.50
		その他製品	2.28
		電気・ガス業	1.30
		陸運業	2.88
		海運業	0.59
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	8.03
		卸売業	6.90
		小売業	4.33
		銀行業	6.49
		証券、商品先物取引業	0.73
		保険業	2.28
		その他金融業	1.15
		不動産業	1.80
		サービス業	4.88
		小計	99.19
合計			99.19

(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	193	円	4,393,933,800	4,491,110,000	0.79

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

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

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	11,500,625,770	98.04
投資証券	日本	146,875,200	1.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	83,044,806	0.71
合計(純資産総額)		11,730,545,776	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	81,445,000	0.69

(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	367,500	1,864.21	685,098,080	2,386.00	876,855,000	7.47
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	43,700	11,874.79	518,928,520	13,315.00	581,865,500	4.96
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	15,500	15,966.07	247,474,227	21,245.00	329,297,500	2.81
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	45,300	5,373.82	243,434,244	6,694.00	303,238,200	2.59
日本	株式	日立製作所	電気機器	32,500	7,216.76	234,545,020	9,298.00	302,185,000	2.58
日本	株式	第一三共	医薬品	64,100	4,558.43	292,195,976	4,347.00	278,642,700	2.38
日本	株式	ダイキン工業	機械	9,100	23,425.76	213,174,451	28,690.00	261,079,000	2.23
日本	株式	三井物産	卸売業	45,500	3,986.64	181,392,169	5,541.00	252,115,500	2.15
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	50,000	3,707.57	185,378,573	4,933.00	246,650,000	2.10
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	41,200	4,195.00	172,834,352	5,750.00	236,900,000	2.02
日本	株式	任天堂	その他製品	36,000	5,277.44	189,988,198	6,450.00	232,200,000	1.98
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	51,900	4,061.81	210,808,173	4,187.00	217,305,300	1.85
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	6,100	29,645.85	180,839,697	35,560.00	216,916,000	1.85
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	37,800	4,624.14	174,792,724	5,450.00	206,010,000	1.76
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	12,400	17,538.94	217,482,957	16,530.00	204,972,000	1.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	62,400	2,541.78	158,607,393	3,259.00	203,361,600	1.73

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	83,600	2,057.07	171,971,660	2,404.00	200,974,400	1.71
日本	株式	村田製作所	電気機器	19,900	7,822.11	155,660,008	8,325.00	165,667,500	1.41
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	99,500	1,501.77	149,426,161	1,578.00	157,011,000	1.34
日本	株式	ファナック	電気機器	33,200	4,590.67	152,410,416	4,348.00	144,353,600	1.23
日本	株式	パナソニック　ホールディングス	電気機器	76,500	1,255.46	96,042,790	1,760.00	134,640,000	1.15
日本	株式	丸紅	卸売業	53,000	1,760.67	93,315,926	2,513.50	133,215,500	1.14
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	62,700	1,901.83	119,245,337	2,080.50	130,447,350	1.11
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	6,600	11,946.38	78,846,161	19,525.00	128,865,000	1.10
日本	株式	小松製作所	機械	32,000	3,226.90	103,261,056	3,964.00	126,848,000	1.08
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	44,100	2,300.30	101,443,390	2,755.50	121,517,550	1.04
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	19,800	5,255.26	104,054,308	5,893.00	116,681,400	0.99
日本	株式	富士通	電気機器	6,100	17,946.34	109,472,679	18,385.00	112,148,500	0.96
日本	株式	オリックス	その他金融業	40,600	2,177.77	88,417,569	2,731.00	110,878,600	0.95
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	12,900	6,778.91	87,448,055	8,247.00	106,386,300	0.91

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	鉱業	0.52
		建設業	1.69
		食料品	3.34
		繊維製品	0.43
		化学	5.53
		医薬品	5.13
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	1.00
		ガラス・土石製品	0.41
		鉄鋼	1.27
		非鉄金属	0.63
		金属製品	0.15
		機械	5.94
		電気機器	21.67
		輸送用機器	8.00
		精密機器	2.22
		その他製品	2.82
		電気・ガス業	1.05
		陸運業	2.71
		海運業	0.49
		空運業	0.16

		倉庫・運輸関連業	0.01
		情報・通信業	5.58
		卸売業	5.45
		小売業	3.65
		銀行業	5.33
		証券、商品先物取引業	0.81
		保険業	3.33
		その他金融業	1.01
		不動産業	2.07
		サービス業	5.21
		小計	98.04
投資証券	—	—	1.25
合計			99.29

(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	1	円	22,180,550	23,270,000	0.20
	大阪取引所	ミニＴＯＰＩＸ先物	買建	25	円	56,612,450	58,175,000	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。

日本債券ツイン戦略マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	27,878,702,100	41.74
社債券	日本	35,043,414,000	52.46
	フランス	1,887,195,000	2.83
	韓国	299,964,000	0.45
	イギリス	201,492,000	0.30
	小計	37,432,065,000	56.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,483,778,246	2.22
合計(純資産総額)		66,794,545,346	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	売建	日本	1,761,600,000	△2.64

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券オプション	買建	日本	22,585,000	0.03
	売建	日本	12,830,000	△0.02

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１１７２回国庫短期証券	6,000,000,000	100.02	6,001,538,000	100.02	6,001,548,000	－	2023/10/30	8.99
日本	国債証券	第１６３回利付国債（２０年）	2,700,000,000	97.18	2,623,928,000	95.75	2,585,277,000	0.600	2037/12/20	3.87
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	2,000,000,000	98.37	1,967,560,000	97.98	1,959,720,000	0.100	2030/9/20	2.93
日本	国債証券	第３７１回利付国債（１０年）	1,600,000,000	99.14	1,586,258,000	98.13	1,570,128,000	0.400	2033/6/20	2.35
日本	国債証券	第１８４回利付国債（２０年）	1,600,000,000	100.46	1,607,398,000	98.09	1,569,584,000	1.100	2043/3/20	2.35
日本	社債券	第１回東京海上日動火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,300,000,000	95.26	1,238,380,000	97.19	1,263,574,000	0.960	2079/12/24	1.89
日本	社債券	第５回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,200,000,000	92.72	1,112,700,000	97.07	1,164,924,000	1.020	2081/2/7	1.74
日本	社債券	第１回武田薬品工業利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	101.15	1,011,566,000	101.05	1,010,560,000	1.720	2079/6/6	1.51

日本	社債券	第１回アサヒグループＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	99.80	998,070,000	100.46	1,004,650,000	0.970	2080/10/15	1.50
日本	社債券	第６回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	1,000,000,000	99.91	999,120,000	99.79	997,950,000	1.130	9999/99/99	1.49
日本	国債証券	第１７５回利付国債（２０年）	1,100,000,000	87.91	967,054,000	90.64	997,117,000	0.500	2040/12/20	1.49
日本	社債券	第１回大樹生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	97.46	974,600,000	98.60	986,050,000	0.740	2051/7/2	1.48
日本	社債券	第１回ドンキホーテＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	900,000,000	100.51	904,653,000	100.24	902,196,000	1.490	2053/11/28	1.35
日本	国債証券	第１７３回利付国債（２０年）	920,000,000	87.02	800,584,000	89.77	825,939,200	0.400	2040/6/20	1.24
日本	国債証券	第１６９回利付国債（２０年）	800,000,000	87.00	696,016,000	89.66	717,336,000	0.300	2039/6/20	1.07
日本	社債券	第１回日本航空株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	93.98	657,888,000	99.62	697,382,000	1.600	2058/10/11	1.04
日本	社債券	第３回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約	700,000,000	99.94	699,580,000	99.60	697,214,000	1.300	9999/99/99	1.04
日本	国債証券	第３７０回利付国債（１０年）	700,000,000	101.29	709,030,000	99.27	694,890,000	0.500	2033/3/20	1.04
日本	国債証券	第７９回利付国債（３０年）	740,000,000	98.89	731,832,000	93.80	694,186,600	1.200	2053/6/20	1.04
日本	社債券	第１回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	96.18	673,295,000	99.07	693,546,000	0.740	2081/10/14	1.04
日本	国債証券	第５８回利付国債（３０年）	680,000,000	90.01	612,122,900	88.28	600,317,600	0.800	2048/3/20	0.90
日本	社債券	第２回住友化学利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	99.45	596,706,000	99.74	598,446,000	0.840	2079/12/13	0.90
日本	社債券	第８回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	600,000,000	99.68	598,116,000	99.45	596,700,000	0.980	9999/99/99	0.89
日本	社債券	第４回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	92.23	645,610,000	84.24	589,743,000	1.810	2055/11/4	0.88
日本	社債券	第１回日本生命第５回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	600,000,000	93.19	559,194,000	97.53	585,210,000	1.050	2050/9/23	0.88
日本	国債証券	第６４回利付国債（３０年）	740,000,000	80.41	595,105,400	78.02	577,407,200	0.400	2049/9/20	0.86
日本	社債券	第７回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	90.58	543,504,000	94.46	566,802,000	1.740	2050/12/2	0.85
日本	国債証券	第６３回利付国債（３０年）	700,000,000	81.99	573,939,000	78.32	548,247,000	0.400	2049/6/20	0.82
日本	国債証券	第７３回利付国債（３０年）	650,000,000	81.76	531,453,000	82.75	537,901,000	0.700	2051/12/20	0.81
日本	社債券	第３回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	600,000,000	81.95	491,754,000	86.30	517,830,000	1.310	2081/6/15	0.78

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	41.74
社債券	56.04
合計	97.78

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債標準物先物	売建	12	円	1,769,556,040	1,761,600,000	△2.64

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

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

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券オプション	店頭	第４４９回利付国債（２年）コール　オプション	売建	115,000,000	円	125,000	805,000	△0.00
	店頭	第１５９回利付国債（５年）コール　オプション	買建	25,000,000	円	40,000	4,875,000	0.01
	店頭	第４４９回利付国債（２年）プット　オプション	買建	115,000,000	円	6,900,000	17,710,000	0.03
	店頭	第１５９回利付国債（５年）プット　オプション	売建	25,000,000	円	1,070,000	12,025,000	△0.02

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

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

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	401,151,391,022	68.19
	イギリス	23,973,534,316	4.08
	カナダ	19,794,318,731	3.36

	フランス	18,765,627,514	3.19
	スイス	18,741,016,583	3.19
	ドイツ	14,383,462,393	2.44
	オランダ	11,413,651,533	1.94
	オーストラリア	11,265,133,385	1.91
	アイルランド	10,469,655,966	1.78
	スウェーデン	4,989,763,860	0.85
	デンマーク	4,902,572,916	0.83
	スペイン	4,260,783,244	0.72
	香港	3,154,055,870	0.54
	イタリア	3,136,671,544	0.53
	シンガポール	1,902,852,929	0.32
	フィンランド	1,803,722,655	0.31
	ジャージー	1,657,667,300	0.28
	ベルギー	1,280,956,139	0.22
	ノルウェー	1,093,303,034	0.19
	イスラエル	1,083,189,354	0.18
	ケイマン	1,001,958,774	0.17
	バミューダ	861,186,763	0.15
	キュラソー	850,469,557	0.14
	ニュージーランド	453,747,600	0.08
	ルクセンブルク	322,575,949	0.05
	オーストリア	321,312,472	0.05
	ポルトガル	309,222,355	0.05
	リベリア	261,962,312	0.04
	パナマ	187,175,300	0.03
	マン島	123,203,497	0.02
	小計	563,916,144,867	95.86
投資信託受益証券	オーストラリア	130,157,789	0.02
	香港	53,307,072	0.01
	小計	183,464,861	0.03
投資証券	アメリカ	9,889,286,200	1.68
	オーストラリア	662,679,082	0.11
	シンガポール	250,272,910	0.04
	フランス	228,644,524	0.04
	イギリス	220,649,169	0.04
	香港	133,074,043	0.02
	カナダ	59,387,303	0.01
	ベルギー	54,528,242	0.01
	小計	11,498,521,473	1.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	12,683,360,078	2.16
合計(純資産総額)		588,281,491,279	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	9,351,047,592	1.59
	買建	カナダ	472,404,816	0.08
	買建	ドイツ	1,949,646,227	0.33
	買建	イギリス	515,199,618	0.09
	買建	オーストラリア	432,039,825	0.07

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	521,614,845	0.09

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
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	24,730.36	29,084,172,959	27,606.15	32,466,246,312	5.52
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	525,636	46,924.68	24,665,303,147	47,700.01	25,072,847,135	4.26
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	686,233	16,931.90	11,619,233,130	18,637.64	12,789,766,149	2.17
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	183,596	54,893.71	10,078,267,050	65,903.47	12,099,614,396	2.06
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	442,712	17,566.27	7,776,799,277	18,689.80	8,274,199,889	1.41
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	212,019	27,327.03	5,793,850,527	37,560.04	7,963,443,562	1.35

アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	164,626	36,939.77	6,081,248,025	45,882.91	7,553,520,864	1.28
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	399,244	17,681.86	7,059,379,349	18,750.41	7,485,992,563	1.27
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	69,339	67,879.87	4,706,722,611	70,895.22	4,915,803,847	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	217,897	19,303.02	4,206,070,607	22,119.60	4,819,795,070	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	96,495	45,194.98	4,361,089,788	49,312.71	4,758,430,501	0.81
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	193,140	21,758.71	4,202,479,084	24,596.44	4,750,557,503	0.81
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	301,729	14,797.62	4,464,871,356	14,683.43	4,430,418,219	0.75
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	120,784	31,714.02	3,830,546,300	33,233.67	4,014,096,503	0.68
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	30,991	114,570.54	3,550,655,856	126,843.39	3,931,003,695	0.67
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	60,041	60,032.07	3,604,385,785	64,631.92	3,880,565,445	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	175,356	20,497.03	3,594,278,595	22,049.11	3,866,445,083	0.66
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	204,409	18,147.23	3,709,459,181	17,392.32	3,555,146,739	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	75,273	41,280.24	3,107,287,889	46,713.22	3,516,244,879	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	63,267	52,774.93	3,338,912,059	55,395.57	3,504,711,603	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	29,993	105,945.59	3,177,626,171	101,443.54	3,042,596,395	0.52
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	133,788	21,720.65	2,905,963,339	22,395.90	2,996,303,191	0.51
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	188,628	15,656.12	2,953,184,150	14,990.74	2,827,675,153	0.48
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	131,130	19,391.83	2,542,851,088	21,265.32	2,788,522,002	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	102,377	25,876.45	2,649,153,650	26,828.00	2,746,570,228	0.47
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	23,718.96	2,918,618,028	22,034.28	2,711,318,154	0.46
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	305,497	8,494.85	2,595,151,862	8,807.80	2,690,758,187	0.46
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	20,525	131,037.72	2,689,549,305	130,680.41	2,682,215,620	0.46
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	32,965	71,508.44	2,357,275,797	79,411.22	2,617,790,880	0.44
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	34,096	58,557.52	1,996,577,485	74,554.80	2,542,020,594	0.43

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	4.76
		素材	4.05
		資本財	6.55
		商業・専門サービス	1.50
		運輸	1.86
		自動車・自動車部品	2.24
		耐久消費財・アパレル	1.65
		消費者サービス	2.11
		メディア・娯楽	5.92
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.30
		生活必需品流通・小売り	1.70
		食品・飲料・タバコ	3.88
		家庭用品・パーソナル用品	1.66
		ヘルスケア機器・サービス	4.46
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.09
		銀行	5.37
		金融サービス	6.40
		保険	2.95
		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	9.15
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.85
		電気通信サービス	1.12
		公益事業	2.78
		半導体・半導体製造装置	6.11
		不動産管理・開発	0.33
		小計	95.86
投資信託受益証券	—	—	0.03
投資証券	—	—	1.95
合計			97.84

(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	288	アメリカドル	64,387,615.4	9,076,722,143	66,333,600	9,351,047,592	1.59
	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	4,324,273	459,843,191	4,442,400	472,404,816	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	3,857,775	624,959,550	3,974,250	643,828,500	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	187	ユーロ	7,974,128.4	1,238,780,846	8,405,650	1,305,817,727	0.22
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	25	オーストラリアドル	4,448,400	417,971,664	4,598,125	432,039,825	0.07
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	37	イギリスポンド	2,712,493.75	491,503,867	2,843,265	515,199,618	0.09

(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	3,150,000.00	441,248,800	443,956,595	0.08
	ユーロ	買建	500,000.00	77,654,000	77,658,250	0.01

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

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

外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	7,810,584,576	67.18
	イギリス	462,611,385	3.98
	フランス	432,045,369	3.72
	カナダ	393,921,664	3.39
	アイルランド	308,063,366	2.65
	スイス	294,498,222	2.53
	オランダ	272,231,183	2.34
	デンマーク	173,527,148	1.49
	オーストラリア	170,177,855	1.46

	ドイツ	165,475,385	1.42
	スウェーデン	99,761,370	0.86
	香港	68,523,832	0.59
	スペイン	60,616,721	0.52
	イタリア	59,141,612	0.51
	フィンランド	52,444,278	0.45
	ジャージー	39,327,725	0.34
	ノルウェー	37,769,939	0.32
	キュラソー	33,184,458	0.29
	シンガポール	21,574,371	0.19
	バミューダ	20,660,493	0.18
	ニュージーランド	11,225,020	0.10
	ベルギー	9,131,594	0.08
	ポルトガル	5,920,000	0.05
	オーストリア	5,089,483	0.04
	イスラエル	5,026,893	0.04
	ルクセンブルク	4,080,268	0.04
	ケイマン	1,822,464	0.02
	小計	11,018,436,674	94.77
投資信託受益証券	オーストラリア	4,178,155	0.04
	香港	1,861,516	0.02
	小計	6,039,671	0.05
投資証券	アメリカ	192,695,100	1.66
	オーストラリア	23,470,643	0.20
	イギリス	4,884,264	0.04
	フランス	3,970,919	0.03
	シンガポール	3,209,749	0.03
	カナダ	2,675,384	0.02
	小計	230,906,059	1.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	371,491,506	3.20
合計(純資産総額)		11,626,873,910	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。

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	259,751,322	2.23
	買建	ドイツ	90,778,772	0.78

(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(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	20,453	47,227.76	965,949,568	47,700.01	975,608,487	8.39
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	7,146	59,502.02	425,201,487	65,903.47	470,946,232	4.05
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	17,234	17,246.26	297,222,214	18,689.80	322,100,058	2.77
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	8,239	36,172.90	298,028,540	37,560.04	309,457,226	2.66
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	15,531	17,342.12	269,340,611	18,750.41	291,212,768	2.50
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,493	23,327.71	174,794,573	24,596.44	184,301,167	1.59
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	4,685	32,359.66	151,605,023	33,233.67	155,699,779	1.34
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	2,329	64,682.67	150,645,950	64,631.92	150,527,755	1.29
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	6,797	20,928.40	142,250,377	22,049.11	149,867,853	1.29
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	2,920	42,405.18	123,823,142	46,713.22	136,402,628	1.17
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	2,454	53,541.81	131,391,616	55,395.57	135,940,732	1.17
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,166	99,548.27	116,073,294	101,443.54	118,283,179	1.02
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,316	16,155.16	118,191,166	14,990.74	109,672,326	0.94
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	3,958	26,230.28	103,819,480	26,828.00	106,185,227	0.91
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,790	22,693.13	108,700,140	22,034.27	105,544,201	0.91
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	796	128,956.03	102,649,004	130,680.41	104,021,614	0.89
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	11,807	8,627.36	101,863,287	8,807.80	103,993,761	0.89

アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1,323	68,330.97	90,401,885	74,554.80	98,636,006	0.85
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	2,883	29,616.38	85,384,045	31,802.83	91,687,565	0.79
イギリス	株式	ASTRAZENECA	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,468	20,696.66	92,472,695	20,037.09	89,525,745	0.77
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	2,105	40,868.61	86,028,430	41,449.40	87,251,006	0.75
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5,837	14,691.78	85,755,920	14,620.50	85,339,859	0.73
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,821	42,069.67	76,608,882	44,483.08	81,003,695	0.70
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	12,155	5,651.48	68,693,829	6,376.07	77,501,169	0.67
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	1,414	52,242.07	73,870,290	54,796.44	77,482,178	0.67
アメリカ	株式	DANAHER CORP	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,997	33,576.23	67,051,741	36,662.06	73,214,150	0.63
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	57,721	1,090.82	62,963,452	1,172.00	67,649,103	0.58
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS	半導体・半導体製造装置	2,616	23,637.84	61,836,614	25,144.81	65,778,846	0.57
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	5,298	12,419.45	65,798,283	12,141.74	64,326,971	0.55
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	12,024	4,652.00	55,935,768	5,191.92	62,427,707	0.54

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	3.08
		素材	4.05
		資本財	5.89
		商業・専門サービス	1.78
		運輸	2.65
		自動車・自動車部品	3.23
		耐久消費財・アパレル	2.53
		消費者サービス	1.69
		メディア・娯楽	7.17
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.36
		生活必需品流通・小売り	0.98
		食品・飲料・タバコ	3.02

		家庭用品・パーソナル用品	3.03
		ヘルスケア機器・サービス	2.72
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.50
		銀行	3.80
		金融サービス	7.18
		保険	3.43
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.09
		ソフトウェア・サービス	14.28
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.61
		電気通信サービス	1.06
		公益事業	1.88
		半導体・半導体製造装置	7.47
		不動産管理・開発	0.28
		小計	94.77
投資信託受益証券	—	—	0.05
投資証券	—	—	1.99
合計			96.80

(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	8	アメリカドル	1,765,964.55	248,948,023	1,842,600	259,751,322	2.23
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	13	ユーロ	565,102.4	87,788,657	584,350	90,778,772	0.78

(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。

世界債券総合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	8,275,887,255	17.81
	中国	2,215,005,457	4.77

	イギリス	1,501,468,487	3.23
	フランス	1,438,061,931	3.10
	イタリア	1,328,290,428	2.86
	ドイツ	1,150,897,120	2.48
	スペイン	924,335,115	1.99
	韓国	611,815,498	1.32
	カナダ	420,561,908	0.91
	オーストラリア	402,780,380	0.87
	ベルギー	323,515,650	0.70
	インドネシア	283,009,074	0.61
	スイス	277,741,698	0.60
	オランダ	267,497,882	0.58
	メキシコ	229,497,636	0.49
	オーストリア	223,203,951	0.48
	マレーシア	183,461,209	0.39
	タイ	162,551,921	0.35
	ポルトガル	128,814,876	0.28
	ポーランド	111,715,286	0.24
	シンガポール	110,495,652	0.24
	アイルランド	108,911,835	0.23
	イスラエル	106,199,438	0.23
	デンマーク	102,657,754	0.22
	フィンランド	91,545,324	0.20
	ルーマニア	79,764,877	0.17
	サウジアラビア	78,660,696	0.17
	チェコ	76,653,172	0.17
	ニュージーランド	76,510,019	0.16
	フィリピン	55,247,399	0.12
	カタール	54,502,386	0.12
	スウェーデン	52,147,601	0.11
	ノルウェー	39,595,465	0.09
	ハンガリー	36,462,703	0.08
	アラブ首長国連邦	24,763,326	0.05
	チリ	22,953,336	0.05
	パナマ	21,689,809	0.05
	ペルー	21,394,966	0.05
	ブルガリア	15,446,071	0.03
	ウルグアイ	13,949,376	0.03
	小計	21,649,663,967	46.60
地方債証券	カナダ	793,935,698	1.71
	ドイツ	260,330,107	0.56
	オーストラリア	196,079,357	0.42

	スウェーデン	29,267,443	0.06
	スペイン	15,474,895	0.03
	デンマーク	12,783,177	0.03
	小計	1,307,870,677	2.82
特殊債券	中国	2,330,238,187	5.02
	国際機関	1,201,962,855	2.59
	ドイツ	431,218,911	0.93
	フランス	275,467,644	0.59
	アメリカ	203,821,194	0.44
	カナダ	177,495,276	0.38
	オランダ	142,608,565	0.31
	日本	136,524,236	0.29
	韓国	92,331,250	0.20
	スウェーデン	56,174,202	0.12
	ノルウェー	55,649,647	0.12
	オーストリア	40,827,595	0.09
	イタリア	14,687,438	0.03
	小計	5,159,007,000	11.11
社債券	アメリカ	5,288,636,837	11.38
	フランス	1,091,594,462	2.35
	カナダ	843,298,310	1.82
	イギリス	823,644,835	1.77
	オランダ	600,974,601	1.29
	日本	426,362,318	0.92
	ドイツ	391,928,816	0.84
	スウェーデン	288,091,256	0.62
	オーストラリア	210,621,580	0.45
	スペイン	195,487,819	0.42
	イタリア	121,545,109	0.26
	シンガポール	108,004,691	0.23
	アイルランド	90,857,066	0.20
	ケイマン	74,892,135	0.16
	スイス	74,628,669	0.16
	デンマーク	69,841,711	0.15
	ノルウェー	62,655,885	0.13
	フィンランド	56,982,504	0.12
	ベルギー	45,135,809	0.10
	ルクセンブルク	42,366,852	0.09
	インドネシア	37,919,119	0.08
	韓国	27,717,189	0.06
	マレーシア	25,534,690	0.05
	バミューダ	24,141,850	0.05

	ジャージー	14,961,090	0.03
	オーストリア	14,454,101	0.03
	メキシコ	13,833,016	0.03
	小計	11,066,112,320	23.82
投資信託受益証券	アメリカ	6,089,493,417	13.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,184,217,032	2.55
合計(純資産総額)		46,456,364,413	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MBS ETF	465,135	13,266.28	6,170,611,895	13,091.88	6,089,493,417	―	―	13.11
アメリカ	国債証券	T 4.25% 09/30/24	1,000,000	14,004.40	140,044,048	13,926.84	139,268,448	4.250	2024/9/30	0.30
アメリカ	国債証券	T 3.25% 08/31/24	1,000,000	13,829.75	138,297,573	13,786.15	137,861,502	3.250	2024/8/31	0.30
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	1,000,000	13,737.93	137,379,363	13,594.24	135,942,437	3.000	2025/7/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	1,000,000	13,643.80	136,438,035	13,569.46	135,694,638	2.250	2024/11/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/15/25	1,000,000	13,715.94	137,159,404	13,553.21	135,532,192	2.750	2025/5/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 3.25% 06/30/27	1,000,000	13,835.43	138,354,345	13,550.74	135,507,412	3.250	2027/6/30	0.29
アメリカ	国債証券	T 2.625% 04/15/25	1,000,000	13,732.16	137,321,650	13,538.90	135,389,020	2.625	2025/4/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/31/27	1,000,000	13,774.31	137,743,110	13,473.37	134,733,730	3.125	2027/8/31	0.29
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	1,000,000	13,552.94	135,529,439	13,441.43	134,414,344	2.000	2025/2/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	1,000,000	13,525.38	135,253,846	13,420.23	134,202,339	1.500	2024/11/30	0.29
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	1,000,000	13,640.34	136,403,435	13,395.45	133,954,541	3.125	2028/11/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/15/25	1,000,000	13,473.09	134,730,976	13,364.34	133,643,414	1.750	2025/3/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/15/24	1,000,000	13,323.86	133,238,677	13,341.21	133,412,136	0.375	2024/9/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	1,000,000	13,518.25	135,182,521	13,331.30	133,313,016	2.250	2025/11/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/31/29	1,000,000	13,699.97	136,999,713	13,328.54	133,285,483	3.125	2029/8/31	0.29
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/25	1,000,000	13,477.50	134,775,029	13,316.43	133,164,337	2.000	2025/8/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 2.75% 04/30/27	1,000,000	13,577.17	135,771,731	13,313.95	133,139,556	2.750	2027/4/30	0.29
アメリカ	国債証券	T 1% 12/15/24	1,000,000	13,358.00	133,580,089	13,311.47	133,114,777	1.000	2024/12/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 1.125% 01/15/25	1,000,000	13,361.31	133,613,128	13,298.26	132,982,617	1.125	2025/1/15	0.29
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	1,000,000	13,253.38	132,533,826	13,079.37	130,793,728	1.625	2026/2/15	0.28
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	1,000,000	13,348.64	133,486,475	13,021.00	130,210,025	2.625	2029/2/15	0.28
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	1,000,000	13,072.07	130,720,731	13,008.61	130,086,125	0.375	2025/4/30	0.28
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/31/25	1,000,000	13,005.79	130,057,967	12,936.47	129,364,755	0.250	2025/5/31	0.28
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/28/27	1,000,000	13,151.50	131,515,098	12,930.69	129,306,934	1.875	2027/2/28	0.28
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	1,000,000	13,054.95	130,549,584	12,903.98	129,039,863	1.500	2026/8/15	0.28
アメリカ	国債証券	T 0.25% 08/31/25	1,000,000	12,906.64	129,066,485	12,822.21	128,222,127	0.250	2025/8/31	0.28
アメリカ	国債証券	T 0.375% 12/31/25	1,000,000	12,857.45	128,574,552	12,730.25	127,302,519	0.375	2025/12/31	0.27

アメリカ	国債証券	T 1.25% 11/30/26	1,000,000	12,903.71	129,037,110	12,718.13	127,181,372	1.250	2026/11/30	0.27
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	1,000,000	12,865.71	128,657,151	12,693.35	126,933,573	1.125	2026/10/31	0.27

(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	46.60
地方債証券	2.82
特殊債券	11.11
社債券	23.82
投資信託受益証券	13.11
合計	97.45

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

投資不動産物件
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	27,350,235,938	17.03
	台湾	22,645,332,911	14.10
	インド	21,921,489,205	13.65
	韓国	19,193,371,090	11.95
	中国	17,587,388,667	10.95
	ブラジル	8,089,354,181	5.04
	サウジアラビア	6,439,255,414	4.01
	南アフリカ	5,150,437,900	3.21
	メキシコ	4,169,898,887	2.60
	タイ	3,030,821,959	1.89
	インドネシア	2,958,056,175	1.84
	マレーシア	2,044,972,480	1.27
	アラブ首長国連邦	2,033,542,957	1.27

	香港	1,545,850,856	0.96
	カタール	1,492,117,256	0.93
	クウェート	1,247,581,752	0.78
	ポーランド	1,196,255,028	0.74
	フィリピン	989,029,853	0.62
	トルコ	975,030,467	0.61
	チリ	841,172,273	0.52
	アメリカ	749,016,084	0.47
	バミューダ	703,753,771	0.44
	ギリシャ	700,961,163	0.44
	ハンガリー	360,313,070	0.22
	チェコ	251,749,402	0.16
	ルクセンブルク	219,884,205	0.14
	コロンビア	128,438,932	0.08
	エジプト	70,716,727	0.04
	シンガポール	27,926,730	0.02
	オランダ	27,518,169	0.02
	ペルー	17,995,131	0.01
	ロシア	116	0.00
	キプロス	—	—
	英ヴァージン諸島	—	—
	小計	154,159,468,749	95.98
投資信託受益証券	ブラジル	365,140,065	0.23
	メキシコ	116,528,852	0.07
	小計	481,668,917	0.30
投資証券	メキシコ	82,715,484	0.05
	南アフリカ	48,623,378	0.03
	小計	131,338,862	0.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,843,587,761	3.64
合計(純資産総額)		160,616,064,289	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,884,978,730	3.66

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

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

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	—	125,432,149	0.08

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	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	3,828,389	1,975.31	7,562,291,644	2,543.61	9,737,961,851	6.06
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	968,500	4,616.36	4,470,950,858	6,335.23	6,135,672,192	3.82
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	743,174	6,913.68	5,138,071,341	7,801.29	5,797,723,326	3.61
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2,575,888	1,333.58	3,435,154,779	1,733.87	4,466,260,078	2.78
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	471,182	4,400.75	2,073,557,768	4,347.47	2,048,450,552	1.28
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	787,350	2,537.88	1,998,207,376	2,574.59	2,027,105,011	1.26
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	812,223	1,557.22	1,264,813,302	1,712.00	1,390,527,400	0.87
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	461,405	2,605.32	1,202,108,692	2,829.05	1,305,340,584	0.81
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	83,801	9,864.89	826,688,086	14,144.00	1,185,281,344	0.74
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	513,793	2,554.21	1,312,338,918	2,305.40	1,184,499,410	0.74
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	14,601,620	82.80	1,209,107,586	80.99	1,182,707,857	0.74
ブラジル	株式	VALE SA	素材	525,387	2,243.91	1,178,921,927	2,014.27	1,058,275,683	0.66
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	8,926.16	722,787,465	12,595.66	1,019,921,742	0.64
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,004,000	712.72	715,577,694	1,015.19	1,019,252,768	0.63
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	360,461	3,101.62	1,118,014,489	2,773.47	999,728,491	0.62
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	313,630	1,891.41	593,203,104	3,046.47	955,467,522	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	459.68	890,975,255	491.22	952,121,592	0.59

ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	351,450	1,670.95	587,256,643	2,688.49	944,871,919	0.59
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	18,968.08	580,252,550	27,721.88	848,040,309	0.53
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	143,181	5,547.83	794,344,330	5,771.20	826,326,474	0.51
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	291,473	3,165.90	922,774,487	2,823.00	822,828,279	0.51
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	125,351	6,242.00	782,440,972	6,475.29	811,685,330	0.51
韓国	株式	POSCO HOLDINGS INC	素材	11,785	33,032.65	389,289,860	68,399.50	806,088,108	0.50
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	158,000	3,656.95	577,799,573	4,903.29	774,720,768	0.48
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE CV	電気通信サービス	4,969,540	166.21	825,992,854	151.34	752,105,500	0.47
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	8,689,300	83.49	725,496,867	85.77	745,324,708	0.46
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	241,804	2,910.56	703,785,849	2,951.85	713,770,056	0.44
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	780,281	821.61	641,088,992	850.02	663,261,987	0.41
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	437,009	1,554.53	679,344,475	1,494.30	653,026,045	0.41
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8,823	81,186.71	716,310,405	73,261.50	646,386,215	0.40

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	4.63
		素材	7.91
		資本財	4.11
		商業・専門サービス	0.03
		運輸	1.99
		自動車・自動車部品	3.69
		耐久消費財・アパレル	1.32
		消費者サービス	2.78
		メディア・娯楽	6.59
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.80
		生活必需品流通・小売り	1.64
		食品・飲料・タバコ	3.57
		家庭用品・パーソナル用品	0.74
		ヘルスケア機器・サービス	1.07
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.59

		銀行	15.75
		金融サービス	2.37
		保険	2.67
		ソフトウェア・サービス	2.17
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.75
		電気通信サービス	2.88
		公益事業	2.49
		半導体・半導体製造装置	8.80
		不動産管理・開発	1.65
		小計	95.98
投資信託受益証券	—	—	0.30
投資証券	—	—	0.08
合計			96.36

(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	792	アメリカドル	40,041,093	5,644,592,880	41,746,320	5,884,978,730	3.66

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

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

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	890,000.00	124,886,000	125,432,149	0.08

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

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）

投資証券	日本	136,729,020,050	97.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	3,946,476,741	2.81
合計(純資産総額)		140,675,496,791	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,911,721,000	2.78

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	15,028	633,105.7	9,514,312,459	596,000	8,956,688,000	6.37
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	13,233	594,187.21	7,862,879,349	572,000	7,569,276,000	5.38
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	41,659	167,074.7	6,960,164,927	169,200	7,048,702,800	5.01
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	22,442	311,833.51	6,998,167,631	290,700	6,523,889,400	4.64
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	43,516	150,828.85	6,563,468,236	140,100	6,096,591,600	4.33
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	61,749	106,570.25	6,580,606,367	97,500	6,020,527,500	4.28
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	19,419	299,843.68	5,822,664,421	280,000	5,437,320,000	3.87
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	25,668	187,902.96	4,823,093,177	180,900	4,643,341,200	3.30
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	28,817	153,490.33	4,423,130,839	153,500	4,423,409,500	3.14
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	12,237	336,895.21	4,122,586,684	346,500	4,240,120,500	3.01
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	62,372	47,551.61	2,965,889,451	58,900	3,673,710,800	2.61
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	38,711	79,622.53	3,082,267,758	84,400	3,267,208,400	2.32
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	8,810	385,611.72	3,397,239,253	354,000	3,118,740,000	2.22
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,448	621,484.9	2,764,364,835	674,000	2,997,952,000	2.13
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	41,544	74,573.37	3,098,076,083	70,600	2,933,006,400	2.08
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	19,656	155,110.99	3,048,861,619	148,800	2,924,812,800	2.08
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,758	428,694.01	2,897,114,119	414,000	2,797,812,000	1.99
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	5,089	492,008.42	2,503,830,849	506,000	2,575,034,000	1.83
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	7,496	333,517.63	2,500,048,154	338,000	2,533,648,000	1.80
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	16,467	161,778.11	2,664,000,137	152,100	2,504,630,700	1.78

日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	8,252	319,183.12	2,633,899,106	300,500	2,479,726,000	1.76
日本	投資証券	イオンリート投資法人	15,802	158,566.4	2,505,666,252	149,700	2,365,559,400	1.68
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,780	512,987.73	2,452,081,349	472,500	2,258,550,000	1.61
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	15,149	158,449.33	2,400,348,900	144,700	2,192,060,300	1.56
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	9,457	210,079.24	1,986,719,372	222,500	2,104,182,500	1.50
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	6,169	312,147.73	1,925,639,346	340,500	2,100,544,500	1.49
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	17,873	115,865.15	2,070,857,825	113,900	2,035,734,700	1.45
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	12,053	169,708.96	2,045,502,094	165,000	1,988,745,000	1.41
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	24,831	73,697.85	1,829,991,313	73,300	1,820,112,300	1.29
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	4,448	442,631.52	1,968,825,000	407,000	1,810,336,000	1.29

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	97.19
合計	97.19

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証ＲＥＩＴ指数先物	買建	2,098	円	3,865,460,100	3,911,721,000	2.78

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

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

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	71,809,336,779	77.40
	オーストラリア	6,077,037,850	6.55

	イギリス	4,240,115,490	4.57
	シンガポール	3,471,511,426	3.74
	フランス	1,594,006,772	1.72
	カナダ	1,534,311,184	1.65
	香港	1,142,990,946	1.23
	ベルギー	960,758,779	1.04
	スペイン	389,603,247	0.42
	ニュージーランド	377,722,049	0.41
	韓国	212,045,806	0.23
	オランダ	183,206,042	0.20
	ガーンジー	167,640,792	0.18
	イスラエル	118,189,031	0.13
	ドイツ	43,411,004	0.05
	アイルランド	31,644,795	0.03
	イタリア	13,254,423	0.01
	小計	92,366,786,415	99.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	413,178,737	0.45
合計(純資産総額)		92,779,965,152	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	35,510,843	0.04

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	462,932	15,513.77	7,181,825,030	17,430.94	8,069,340,148	8.70
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	46,751	85,869.73	4,014,495,889	112,403.83	5,254,991,886	5.66
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	79,178	40,248.02	3,186,758,208	39,687.28	3,142,359,780	3.39
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	337,015	8,895.96	2,998,074,742	8,665.42	2,920,378,510	3.15
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	163,711	15,939.53	2,609,477,190	17,547.94	2,872,791,722	3.10

アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	248,848	9,518.09	2,368,558,169	11,419.97	2,841,839,108	3.06
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	146,417	13,748.67	2,013,040,408	17,308.29	2,534,228,863	2.73
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	503,165	4,451.80	2,239,992,067	4,481.43	2,254,901,896	2.43
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	105,570	19,588.49	2,067,957,165	19,854.21	2,096,009,456	2.26
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	71,187	22,577.59	1,607,231,141	26,238.74	1,867,857,619	2.01
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	861,449	1,630.11	1,404,258,468	1,926.18	1,659,305,835	1.79
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	171,092	8,440.42	1,444,088,739	9,136.26	1,563,141,971	1.68
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	291,851	4,230.72	1,234,740,134	5,000.20	1,459,315,092	1.57
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	79,087	19,865.96	1,571,139,292	17,834.11	1,410,446,629	1.52
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	201,590	5,961.52	1,201,782,947	6,784.88	1,367,765,189	1.47
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	146,534	6,995.76	1,025,117,565	8,537.14	1,250,981,742	1.35
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	58,819	21,507.87	1,265,071,839	20,967.87	1,233,309,604	1.33
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	62,748	18,948.65	1,188,990,150	18,537.55	1,163,194,501	1.25
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	32,393	29,470.14	954,626,547	33,453.59	1,083,662,164	1.17
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	106,177	11,042.18	1,172,425,556	9,604.28	1,019,754,285	1.10
香港	投資証券	LINK REIT	1,268,300	891.52	1,130,720,904	797.32	1,011,251,102	1.09
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	359,759	2,374.46	854,234,663	2,562.83	922,002,813	0.99
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	313,435	2,917.43	914,427,496	2,844.77	891,651,927	0.96
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	88,540	8,799.94	779,146,797	10,035.65	888,556,832	0.96
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	132,802	7,073.57	939,385,118	6,690.43	888,503,308	0.96
アメリカ	投資証券	UDR INC	153,571	5,345.58	820,926,435	5,672.63	871,151,892	0.94
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	276,817	3,350.61	927,508,282	3,063.27	847,967,454	0.91
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	619,040	1,433.31	887,278,015	1,366.61	845,986,502	0.91
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	155,862	4,234.73	660,034,859	5,214.48	812,739,329	0.88
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	52,967	15,408.02	816,116,648	15,296.65	810,217,909	0.87

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	99.55
合計	99.55

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	72,000.00	10,146,240	10,146,679	0.01
	イギリスポンド	買建	140,000.00	25,363,142	25,364,164	0.03

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

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

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	11,239,242,063	44.63
	ルクセンブルク	11,170,096,278	44.36
	イギリス	993,204,135	3.94
	アメリカ	692,024,549	2.75
	ジャージー	638,312,160	2.53
	小計	24,732,879,185	98.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	448,475,967	1.78
合計(純資産総額)		25,181,355,152	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	140,948,100	0.56

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 008 10/24/23	49,000,000	21,376.69	10,474,578,492	22,937.22	11,239,242,063	0.000	2023/10/24	44.63
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 031 11/30/23	24,000,000	12,511.08	3,002,661,000	13,434.44	3,224,265,840	0.000	2023/11/30	12.80
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 033 03/28/24	20,000,000	12,772.65	2,554,531,467	13,551.44	2,710,289,220	0.000	2024/3/28	10.76
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 030 09/29/23	20,000,000	12,387.03	2,477,406,780	13,339.99	2,667,998,220	0.000	2023/9/29	10.60

ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 032 01/31/24	19,000,000	12,646.41	2,402,819,553	13,513.38	2,567,542,998	0.000	2024/1/31	10.20
イギリス	社債券	BAR USD COM 041 05/31/24	7,000,000	13,589.50	951,265,560	14,188.63	993,204,135	0.000	2024/5/31	3.94
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000	4,175.53	626,329,710	4,613.49	692,024,549	0.000	2036/6/12	2.75
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000	1,467.49	586,999,080	1,595.78	638,312,160	0.000	9999/99/99	2.53

(注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	98.22
合計	98.22

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,000,000.00	139,440,000	140,948,100	0.56

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

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

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	31,264,945,514	97.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	666,676,025	2.09
合計(純資産総額)		31,931,621,539	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	222,574,527	0.70
	売建	—	31,500,521,513	△98.65

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	5,974,795	5,141.69	30,720,601,340	5,232.80	31,264,945,514	97.91

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	97.91
合計	97.91

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,579,124.00	220,193,050	222,574,527	0.70
	アメリカドル	売建	223,594,600.00	31,710,946,723	31,500,521,513	△98.65

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

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

米国株式ＬＳマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	アイルランド	21,684,367,692	95.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	927,395,763	4.10
合計(純資産総額)		22,611,763,455	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建	―	21,557,074,000	△95.34

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(％)	償還期限	投資比率(％)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/27	123,000,000	17,430.70	21,439,762,046	17,629.56	21,684,367,692	0.000	2027/10/18	95.90

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
社債券	95.90
合計	95.90

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	売建	154,000,000.00	21,669,032,000	21,557,074,000	△95.34

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

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

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	20,026,197,000	94.47
	イギリス	985,100,000	4.65
	小計	21,011,297,000	99.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	186,875,339	0.88
合計(純資産総額)		21,198,172,339	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	ＳＴＡＲ ＨＥＬＩＯＳ ０% ０７／１６／２４	16,230,000,000	127.08	20,625,084,000	123.39	20,026,197,000	0.000	2024/7/16	94.47
イギリス	社債券	ソシエテ・ジェネラル ０% ２０２４／０５／３１	1,000,000,000	99.41	994,160,000	98.51	985,100,000	0.000	2024/5/31	4.65

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）

社債券	99.12
合計	99.12

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	9,077,062,500	99.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	85,232,719	0.93
合計(純資産総額)		9,162,295,219	100.00

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　１０／１８／２３	10,125,000,000	89.90	9,102,414,400	89.65	9,077,062,500	0.000	2023/10/18	99.07

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	99.07
合計	99.07

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

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	11,828,426,080	55.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	9,624,399,989	44.86
合計(純資産総額)		21,452,826,069	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	日本	6,018,800,000	28.06
	売建	アメリカ	3,782,766,953	△17.63
	売建	ドイツ	4,069,713,271	△18.97
	売建	イギリス	4,154,854,392	△19.37

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

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

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	―	1,998,820,937	9.32
	売建	―	3,245,506,758	△15.13

(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(%)
日本	国債証券	第１１５２回国庫短期証券	7,000,000,000	100.14	7,010,097,500	100.09	7,006,356,000	—	2024/4/22	32.66
日本	国債証券	第１１１５回国庫短期証券	2,120,000,000	100.06	2,121,399,200	100.02	2,120,538,480	—	2023/10/20	9.88
日本	国債証券	第１１４５回国庫短期証券	1,700,000,000	100.15	1,702,679,200	100.07	1,701,356,600	—	2024/3/21	7.93
日本	国債証券	第１１０８回国庫短期証券	1,000,000,000	100.08	1,000,838,000	100.01	1,000,175,000	—	2023/9/20	4.66

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	55.14
合計	55.14

(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	日本	大阪取引所	長期国債標準物先物	買建	41	円	6,067,903,530	6,067,903,530	6,018,800,000	6,018,800,000	28.06
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	売建	241	アメリカドル	27,127,169.58	3,824,117,095	26,833,843.75	3,782,766,953	△17.63
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	売建	197	ユーロ	26,357,676.3	4,094,665,013	26,197,060	4,069,713,271	△18.97
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	LONG GILT FU	売建	239	イギリスポンド	22,718,802.5	4,116,647,013	22,929,660	4,154,854,392	△19.37

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	8,452,000.00	1,174,801,656	1,188,697,732	5.54
	イギリスポンド	買建	193,000.00	34,384,975	34,892,218	0.16
	スウェーデンクローナ	買建	22,713,000.00	299,903,339	303,350,283	1.41
	ノルウェークローネ	買建	24,928,000.00	344,170,924	344,150,982	1.60
	オーストラリアドル	買建	1,362,000.00	127,747,019	127,729,722	0.60
	カナダドル	売建	1,609,000.00	170,734,529	170,742,896	△0.80
	ユーロ	売建	2,757,000.00	433,094,580	427,606,286	△1.99
	スイスフラン	売建	14,557,000.00	2,326,659,717	2,356,472,603	△10.98
	ニュージーランドドル	売建	3,356,000.00	290,886,650	290,684,973	△1.35

(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。

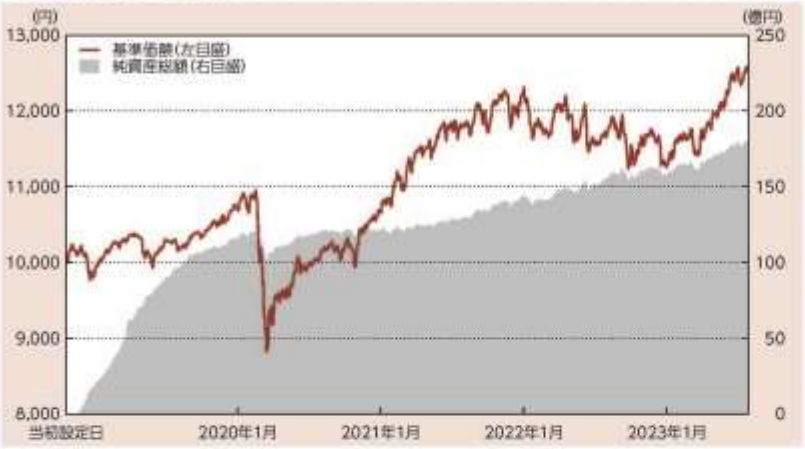
≪参考情報≫

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：2018年10月26日
作成基準日：2023年７月31日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	12,557円
純資産総額	179.63億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2019年７月	0円
2020年７月	0円
2021年７月	0円
2022年７月	0円
2023年７月	0円
設定来分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
国内株式インデックス マザーファンド	12.9%
J-REIT インデックス マザーファンド	8.0%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.8%
グローバルREITインデックス マザーファンド	5.0%
FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	3.5%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	3.5%
外国株式インデックス マザーファンド	3.4%
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	3.4%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	3.3%
ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3.3%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）

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

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

＜申込コース＞

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

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

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

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

＜申込価額＞

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

＜申込手数料＞

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

＜申込代金の支払い＞

販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

＜申込受付の中止等＞

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

＜その他＞

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

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

＜スイッチング＞

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

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

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜解約価額＞

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

＜一部解約代金の支払い＞

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

＜受付不可日＞

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

＜一部解約受付の中止等＞

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

②外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）の評価方法

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

③外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

④マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

⑤マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

・公社債等（仕組債を含みます。）

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

・市場デリバティブ取引

金融商品取引所が発表する計算日の清算値段又は帳入値段で評価します。

・店頭デリバティブ取引

計算日における次のa.又はb.のいずれかの価額で評価します。

a.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

b.価格情報会社の提供する価額

⑥外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします。（2018年10月26日設定）

ただし、下記「(5)その他　＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

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

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

（５）【その他】

＜投資信託契約の終了（償還）と手続き＞

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらか

じめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

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

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき
・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファン

ドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

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

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

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

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2022年7月12日から2023年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 （2022年 7月11日現在）	第5期 （2023年 7月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	582,479,964	778,855,595
投資信託受益証券	5,668,345,514	6,162,093,059
投資証券	675,030,861	1,256,041,447
親投資信託受益証券	8,369,881,086	8,842,340,311
未収入金	15,000,000	1,017,650,000
流動資産合計	15,310,737,425	18,056,980,412
資産合計	15,310,737,425	18,056,980,412
負債の部		
流動負債		
未払金	-	167,507,011
未払解約金	7,738,638	50,401,861
未払受託者報酬	3,950,981	4,556,950
未払委託者報酬	105,096,063	121,214,787
未払利息	178	649
その他未払費用	395,039	455,635
流動負債合計	117,180,899	344,136,893
負債合計	117,180,899	344,136,893
純資産の部		
元本等		
元本	13,098,897,602	14,294,735,341
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,094,658,924	3,418,108,178
（分配準備積立金）	1,343,608,716	2,030,051,856
元本等合計	15,193,556,526	17,712,843,519
純資産合計	15,193,556,526	17,712,843,519
負債純資産合計	15,310,737,425	18,056,980,412

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自　2021年 7月13日 至　2022年 7月11日	第5期 自　2022年 7月12日 至　2023年 7月10日
営業収益		
受取配当金	3,198,433	6,666,754
受取利息	4,550	2,548
有価証券売買等損益	△73,245,562	1,365,844,194
その他収益	-	117,518
営業収益合計	△70,042,579	1,372,631,014
営業費用		
支払利息	223,629	510,371
受託者報酬	7,709,621	8,943,449
委託者報酬	205,075,809	237,895,697
その他費用	770,839	894,224
営業費用合計	213,779,898	248,243,741
営業利益又は営業損失（△）	△283,822,477	1,124,387,273
経常利益又は経常損失（△）	△283,822,477	1,124,387,273
当期純利益又は当期純損失（△）	△283,822,477	1,124,387,273
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（△）	19,126,721	34,256,066
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,964,125,640	2,094,658,924
剰余金増加額又は欠損金減少額	726,400,754	462,062,845
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	726,400,754	462,062,845
剰余金減少額又は欠損金増加額	292,918,272	228,744,798
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	292,918,272	228,744,798
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,094,658,924	3,418,108,178

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
３.その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は2022年 7月12日から2023年 7月10日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第4期 (2022年 7月11日現在)	第5期 (2023年 7月10日現在)
１．計算期間の末日における受益権の総数	13,098,897,602口	14,294,735,341口
２．計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.1599円 (1万口当たり純資産額) (11,599円)	1口当たり純資産額 1.2391円 (1万口当たり純資産額) (12,391円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日	第5期 自 2022年 7月12日 至 2023年 7月10日

分配金の計算過程

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

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	174,343,378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	642,165,001円
収益調整金額	C	1,388,056,322円
分配準備積立金額	D	1,213,543,477円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,418,108,178円
当ファンドの期末残存口数	F	14,294,735,341口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,391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5期 自 2022年 7月12日 至 2023年 7月10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5期 (2023年 7月10日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	第5期 (2023年 7月10日現在)
2 .時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3 .金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	第4期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日	第5期 自 2022年 7月12日 至 2023年 7月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	10,867,635,054円	13,098,897,602円
期中追加設定元本額	3,838,843,288円	2,620,317,864円
期中一部解約元本額	1,607,580,740円	1,424,480,125円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	第4期 (2022年 7月11日現在)	第5期 (2023年 7月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

投資信託受益証券	△42,037,863	410,793,555
投資証券	△22,733,918	54,388,956
親投資信託受益証券	69,314,971	607,532,354
合計	4,543,190	1,072,714,865

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ノムラＦＯＦｓ用　日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	431,473,873	382,544,735	
	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	301,319,198	434,200,964	
	世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	503,619,253	583,745,076	
	明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	282,675,041	272,837,949	
	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	423,499,014	585,699,136	
	ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	107,709,495	108,861,986	
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	302,364,573	585,952,306	
	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	169,475,342	184,677,280	
	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	240,656,609	602,483,820	
	ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	144,073,662	184,572,768	
	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	460,382,459	585,284,220	
	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	290,169,024	259,759,310	
	ＦＯＦｓ用　ピクテ　マルチストラテジー　リンクファンド（適格機関投資家専用）	335,465,127	342,140,883	

	ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド（適格機関投資家専用）	108,169,508	108,688,721	
	FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	455,024,284	613,281,729	
	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	338,498,787	327,362,176	
投資信託受益証券合計		4,894,575,249	6,162,093,059	
投資証券	MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	14,005	146,884,440	
	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	25,089.539	266,736,674	
	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	320,651.111	577,171,999	
	MA Hedge Fund Strategies Limited	26,993	265,248,334	
投資証券合計		386,738.65	1,256,041,447	
親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	637,380,154	1,339,326,917	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	345,064,516	879,431,425	
	新興国株式インデックス　マザーファンド	49,096,565	185,555,557	
	国内株式インデックス　マザーファンド	966,086,171	2,202,000,209	
	外国株式インデックス　マザーファンド	111,777,690	560,095,649	
	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	555,425,246	320,258,196	
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	912,842,328	1,134,663,013	
	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	324,710,324	400,984,779	
	日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	177,935,243	218,397,717	
	外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	155,144,883	203,844,861	
	米国株式ＬＳマザーファンド	399,064,145	432,944,690	
	日本債券ツイン戦略マザーファンド	285,719,976	271,805,413	
	ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	128,875,338	149,972,230	
	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	162,972,915	146,643,028	
	世界債券総合インデックスマザーファンド	379,636,686	396,416,627	
親投資信託受益証券合計		5,591,732,180	8,842,340,311	
合計			16,260,474,817	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,282,019,730
株式	553,511,905,010
新株予約権証券	5,236,000
派生商品評価勘定	18,175,150
未収入金	4,967,981,358
未収配当金	782,472,770
差入委託証拠金	74,960,000
流動資産合計	569,642,750,018
資産合計	569,642,750,018
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,807,000
前受金	7,394,000
未払解約金	8,633,344,245
未払利息	8,572
流動負債合計	8,651,553,817
負債合計	8,651,553,817
純資産の部	
元本等	
元本	246,129,288,443
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	314,861,907,758
元本等合計	560,991,196,201
純資産合計	560,991,196,201
負債純資産合計	569,642,750,018

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10日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)新株予約権証券

	2023年 7月10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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。
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10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	246,129,288,443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 2.2793円 (1万口当たり純資産額) (22,793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 7月10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 7月10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株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	263,755,440,320円
期中追加設定元本額	19,919,508,116円
期中一部解約元本額	37,545,659,993円
期末元本額	246,129,288,443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）	334,440,574円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	3,478,966,595円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	11,888,614円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	11,425,697,173円
世界経済インデックスファンド	4,730,848,532円
日本株式インデックス・オープン	3,057,723,990円
ＤＣマイセレクション２５	5,522,026,302円
ＤＣマイセレクション５０	17,754,209,408円
ＤＣマイセレクション７５	18,472,400,144円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	6,021,294,867円
ＤＣマイセレクションＳ２５	3,250,318,721円
ＤＣマイセレクションＳ５０	9,440,815,037円
ＤＣマイセレクションＳ７５	8,016,312,204円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	8,988,629,087円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	130,862,339円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	680,289,988円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	520,094,999円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,696,348,044円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	991,965,622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）	9,750,591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）	159,175,190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

区分	2023年 7月10日現在
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	76,818,281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）	621,508,074円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	336,463,328円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,265,797,256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）	14,199,279円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	352,186,015円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	203,127,329円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	261,403,222円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	22,312,988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）	448,363,056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	1,799,864,861円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,224,394,382円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,775,115,228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）	564,183,861円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	399,385,889円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,306,047,151円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,253,478円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,567,282円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	50,643,883円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	23,675,515,033円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	283,531,608円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	49,491,712円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	199,373,314円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	34,041,665円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	11,353,371円
グローバル経済コア	211,593,399円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	33,074,251円
Ｍｙ　ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	754,779,953円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	28,119,531円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	966,086,171円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	215,887,042円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	54,123,858円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	49,045,377円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	19,918,462円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	20,893,114円
１０資産分散投資ファンド	93,062,081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）	42,053,572,413円

区分	2023年 7月10日現在
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）	578,742,860円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	292,392,888円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,954,754円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	690,518,488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）	45,194,817,771円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,017,043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）	214,149,302円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	20,384,827,971
新株予約権証券	5,236,000
合計	20,390,063,971

(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 7月10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	2,320,646,000	－	2,328,040,000	7,394,000
合計		2,320,646,000	－	2,328,040,000	7,394,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

		評価額	

銘　柄	株式数 (株)	単価(円)	金額(円)	備考
極洋	9,200	3,620.00	33,304,000	
ニッスイ	242,100	644.00	155,912,400	
マルハニチロ	35,900	2,441.50	87,649,850	
雪国まいたけ	20,600	936.00	19,281,600	
カネコ種苗	7,400	1,400.00	10,360,000	
サカタのタネ	27,600	4,120.00	113,712,000	
ホクト	21,500	1,834.00	39,431,000	
ホクリヨウ	2,700	884.00	2,386,800	
住石ホールディングス	29,300	353.00	10,342,900	
日鉄鉱業	9,700	4,510.00	43,747,000	
三井松島ホールディングス	11,000	2,722.00	29,942,000	
ＩＮＰＥＸ	895,600	1,616.50	1,447,737,400	
石油資源開発	28,100	4,425.00	124,342,500	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	11,000	2,235.00	24,585,000	
ショーボンドホールディングス	33,000	5,625.00	185,625,000	
ミライト・ワン	80,100	1,799.00	144,099,900	
タマホーム	15,200	3,320.00	50,464,000	
サンヨーホームズ	2,300	721.00	1,658,300	
日本アクア	7,900	878.00	6,936,200	
ファーストコーポレーション	4,800	808.00	3,878,400	
ベステラ	4,100	1,142.00	4,682,200	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	41,200	188.00	7,745,600	
キャンディル	3,400	591.00	2,009,400	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	1,378.00	5,236,400	
第一カッター興業	6,200	1,398.00	8,667,600	
安藤・間	140,300	1,066.00	149,559,800	
東急建設	69,000	736.00	50,784,000	
コムシスホールディングス	77,300	2,764.50	213,695,850	
ビーアールホールディングス	38,500	387.00	14,899,500	
高松コンストラクショングループ	15,700	2,524.00	39,626,800	
東建コーポレーション	7,000	7,360.00	51,520,000	
ソネック	2,000	971.00	1,942,000	
ヤマウラ	12,300	1,141.00	14,034,300	
オリエンタル白石	87,000	299.00	26,013,000	
大成建設	158,500	5,047.00	799,949,500	
大林組	605,800	1,230.00	745,134,000	
清水建設	480,300	897.60	431,117,280	
飛島建設	18,700	1,283.00	23,992,100	
長谷工コーポレーション	174,800	1,788.50	312,629,800	
松井建設	15,800	711.00	11,233,800	
錢高組	1,700	3,125.00	5,312,500	

鹿島建設	375,600	2,156.00	809,793,600	
不動テトラ	11,700	1,842.00	21,551,400	
大末建設	4,800	1,338.00	6,422,400	
鉄建建設	12,100	2,032.00	24,587,200	
西松建設	28,700	3,540.00	101,598,000	
三井住友建設	136,600	372.00	50,815,200	
大豊建設	7,000	3,845.00	26,915,000	
佐田建設	8,400	463.00	3,889,200	
ナカノフドー建設	9,400	388.00	3,647,200	
奥村組	27,500	4,075.00	112,062,500	
東鉄工業	23,300	2,618.00	60,999,400	
イチケン	3,000	1,965.00	5,895,000	
富士ピー・エス	5,900	450.00	2,655,000	
淺沼組	13,600	3,325.00	45,220,000	
戸田建設	208,400	774.00	161,301,600	
熊谷組	28,400	3,085.00	87,614,000	
北野建設	2,500	3,020.00	7,550,000	
植木組	3,700	1,396.00	5,165,200	
矢作建設工業	23,000	1,237.00	28,451,000	
ピーエス三菱	21,500	775.00	16,662,500	
日本ハウスホールディングス	33,600	366.00	12,297,600	
新日本建設	23,800	1,227.00	29,202,600	
東亜道路工業	6,700	4,605.00	30,853,500	
日本道路	3,400	8,850.00	30,090,000	
東亜建設工業	14,500	3,100.00	44,950,000	
日本国土開発	48,200	577.00	27,811,400	
若築建設	7,500	3,000.00	22,500,000	
東洋建設	56,200	1,031.00	57,942,200	
五洋建設	240,100	759.10	182,259,910	
世紀東急工業	21,800	1,425.00	31,065,000	
福田組	6,400	4,760.00	30,464,000	
住友林業	130,800	3,303.00	432,032,400	
日本基礎技術	8,000	503.00	4,024,000	
巴コーポレーション	14,700	500.00	7,350,000	
大和ハウス工業	468,400	3,690.00	1,728,396,000	
ライト工業	31,400	1,982.00	62,234,800	
積水ハウス	513,600	2,861.50	1,469,666,400	
日特建設	16,200	1,079.00	17,479,800	
北陸電気工事	11,600	930.00	10,788,000	
ユアテック	37,300	869.00	32,413,700	
日本リーテック	14,900	1,360.00	20,264,000	
四電工	7,100	2,204.00	15,648,400	

中電工	26,300	2,314.00	60,858,200	
関電工	92,800	1,181.00	109,596,800	
きんでん	119,200	1,976.50	235,598,800	
東京エネシス	16,800	954.00	16,027,200	
トーエネック	5,600	3,605.00	20,188,000	
住友電設	16,100	3,155.00	50,795,500	
日本電設工業	27,800	2,033.00	56,517,400	
エクシオグループ	78,000	2,835.00	221,130,000	
新日本空調	9,400	2,319.00	21,798,600	
九電工	41,200	3,982.00	164,058,400	
三機工業	37,600	1,510.00	56,776,000	
日揮ホールディングス	167,500	1,802.50	301,918,750	
中外炉工業	5,500	1,991.00	10,950,500	
ヤマト	11,000	910.00	10,010,000	
太平電業	10,500	4,215.00	44,257,500	
高砂熱学工業	40,800	2,441.00	99,592,800	
三晃金属工業	1,600	4,455.00	7,128,000	
朝日工業社	7,000	2,371.00	16,597,000	
明星工業	29,100	953.00	27,732,300	
大氣社	19,500	4,005.00	78,097,500	
ダイダン	11,100	2,792.00	30,991,200	
日比谷総合設備	14,500	2,145.00	31,102,500	
フィル・カンパニー	3,000	930.00	2,790,000	
テスホールディングス	18,700	690.00	12,903,000	
インフロニア・ホールディングス	177,500	1,332.00	236,430,000	
東洋エンジニアリング	22,400	564.00	12,633,600	
レイズネクスト	24,500	1,456.00	35,672,000	
ニップン	45,800	1,837.00	84,134,600	
日清製粉グループ本社	157,300	1,718.50	270,320,050	
日東富士製粉	3,000	4,590.00	13,770,000	
昭和産業	14,800	2,639.00	39,057,200	
鳥越製粉	10,600	616.00	6,529,600	
中部飼料	23,500	1,075.00	25,262,500	
フィード・ワン	24,900	746.00	18,575,400	
東洋精糖	2,500	1,723.00	4,307,500	
日本甜菜製糖	9,900	1,891.00	18,720,900	
DM三井製糖ホールディングス	16,900	2,729.00	46,120,100	
塩水港精糖	15,800	217.00	3,428,600	
ウェルネオシュガー	8,800	2,041.00	17,960,800	
森永製菓	31,100	4,556.00	141,691,600	
中村屋	4,200	3,070.00	12,894,000	
江崎グリコ	48,600	3,706.00	180,111,600	

名糖産業	6,700	1,633.00	10,941,100	
井村屋グループ	9,300	2,228.00	20,720,400	
不二家	11,700	2,431.00	28,442,700	
山崎製パン	113,800	1,991.50	226,632,700	
第一屋製パン	2,500	391.00	977,500	
モロゾフ	5,500	3,735.00	20,542,500	
亀田製菓	10,800	4,270.00	46,116,000	
寿スピリッツ	18,100	10,020.00	181,362,000	
カルビー	77,900	2,724.00	212,199,600	
森永乳業	30,900	4,728.00	146,095,200	
六甲バター	12,500	1,303.00	16,287,500	
ヤクルト本社	121,500	8,805.00	1,069,807,500	
明治ホールディングス	208,500	3,264.00	680,544,000	
雪印メグミルク	41,100	1,941.00	79,775,100	
プリマハム	22,800	2,185.00	49,818,000	
日本ハム	66,500	3,937.00	261,810,500	
林兼産業	4,000	491.00	1,964,000	
丸大食品	17,100	1,481.00	25,325,100	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	18,800	3,135.00	58,938,000	
柿安本店	6,600	2,340.00	15,444,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	129,900	718.00	93,268,200	
サッポロホールディングス	56,000	3,609.00	202,104,000	
アサヒグループホールディングス	393,000	5,452.00	2,142,636,000	
キリンホールディングス	767,400	2,075.00	1,592,355,000	
宝ホールディングス	116,100	1,141.00	132,470,100	
オエノンホールディングス	50,800	335.00	17,018,000	
養命酒製造	5,600	1,861.00	10,421,600	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	133,200	1,533.50	204,262,200	
サントリー食品インターナショナル	119,700	5,068.00	606,639,600	
ダイドーグループホールディングス	9,600	5,010.00	48,096,000	
伊藤園	57,600	3,859.00	222,278,400	
キーコーヒー	19,100	2,053.00	39,212,300	
ユニカフェ	4,400	916.00	4,030,400	
ジャパンフーズ	2,100	1,073.00	2,253,300	
日清オイリオグループ	24,000	3,630.00	87,120,000	
不二製油グループ本社	39,600	1,986.50	78,665,400	
かどや製油	1,600	3,435.00	5,496,000	
Ｊ－オイルミルズ	17,300	1,609.00	27,835,700	
キッコーマン	112,700	7,886.00	888,752,200	
味の素	410,600	5,615.00	2,305,519,000	
ブルドックソース	9,000	1,924.00	17,316,000	
キユーピー	91,400	2,462.50	225,072,500	

ハウス食品グループ本社	52,100	3,286.00	171,200,600	
カゴメ	79,200	3,126.00	247,579,200	
焼津水産化学工業	5,200	823.00	4,279,600	
アリアケジャパン	14,800	5,287.00	78,247,600	
ピエトロ	1,900	1,821.00	3,459,900	
エバラ食品工業	4,600	2,886.00	13,275,600	
やまみ	1,300	1,324.00	1,721,200	
ニチレイ	77,900	3,046.00	237,283,400	
東洋水産	85,900	6,105.00	524,419,500	
イートアンドホールディングス	7,300	2,146.00	15,665,800	
大冷	1,600	1,958.00	3,132,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,800	862.00	9,309,600	
日清食品ホールディングス	59,800	11,905.00	711,919,000	
永谷園ホールディングス	8,300	2,132.00	17,695,600	
一正蒲鉾	5,700	739.00	4,212,300	
フジッコ	17,500	1,888.00	33,040,000	
ロック・フィールド	19,000	1,476.00	28,044,000	
日本たばこ産業	1,119,500	3,051.00	3,415,594,500	
ケンコーマヨネーズ	11,700	1,314.00	15,373,800	
わらべや日洋ホールディングス	12,500	2,655.00	33,187,500	
なとり	10,700	1,952.00	20,886,400	
イフジ産業	2,300	1,109.00	2,550,700	
ファーマフーズ	24,400	1,898.00	46,311,200	
ユーグレナ	109,900	889.00	97,701,100	
紀文食品	13,300	1,031.00	13,712,300	
ピックルスホールディングス	10,000	1,288.00	12,880,000	
ミヨシ油脂	4,700	1,029.00	4,836,300	
理研ビタミン	14,700	2,027.00	29,796,900	
片倉工業	16,300	1,605.00	26,161,500	
グンゼ	12,400	4,355.00	54,002,000	
東洋紡	75,300	1,111.00	83,658,300	
ユニチカ	54,800	234.00	12,823,200	
富士紡ホールディングス	7,000	3,195.00	22,365,000	
倉敷紡績	13,200	2,264.00	29,884,800	
シキボウ	7,500	1,027.00	7,702,500	
日本毛織	46,200	1,023.00	47,262,600	
トーア紡コーポレーション	5,300	455.00	2,411,500	
帝国繊維	19,900	1,649.00	32,815,100	
帝人	166,600	1,476.50	245,984,900	
東レ	1,159,900	796.90	924,324,310	
住江織物	2,900	2,381.00	6,904,900	
日本フエルト	8,900	417.00	3,711,300	

イチカワ	2,100	1,351.00	2,837,100	
日東製網	1,400	1,406.00	1,968,400	
アツギ	8,400	416.00	3,494,400	
ダイニック	3,500	764.00	2,674,000	
セーレン	33,600	2,418.00	81,244,800	
ソトー	4,600	765.00	3,519,000	
東海染工	1,500	1,095.00	1,642,500	
小松マテーレ	25,400	680.00	17,272,000	
ワコールホールディングス	31,600	2,919.00	92,240,400	
ホギメディカル	23,300	3,095.00	72,113,500	
ＴＳＩホールディングス	58,500	803.00	46,975,500	
マツオカコーポレーション	3,800	1,267.00	4,814,600	
ワールド	22,400	1,709.00	38,281,600	
三陽商会	5,100	1,956.00	9,975,600	
ナイガイ	5,300	293.00	1,552,900	
オンワードホールディングス	112,700	530.00	59,731,000	
ルックホールディングス	3,900	2,542.00	9,913,800	
ゴールドウイン	30,700	11,835.00	363,334,500	
デサント	29,900	4,015.00	120,048,500	
キング	6,300	615.00	3,874,500	
ヤマトインターナショナル	11,400	296.00	3,374,400	
特種東海製紙	7,700	3,235.00	24,909,500	
王子ホールディングス	720,700	525.90	379,016,130	
日本製紙	90,100	1,200.00	108,120,000	
三菱製紙	16,200	576.00	9,331,200	
北越コーポレーション	109,300	807.00	88,205,100	
中越パルプ工業	5,400	1,376.00	7,430,400	
巴川製紙所	4,200	715.00	3,003,000	
大王製紙	76,400	1,113.50	85,071,400	
阿波製紙	3,200	574.00	1,836,800	
レンゴー	157,600	861.70	135,803,920	
トーモク	10,000	2,077.00	20,770,000	
ザ・パック	12,900	3,105.00	40,054,500	
北の達人コーポレーション	72,900	277.00	20,193,300	
クラレ	275,000	1,384.00	380,600,000	
旭化成	1,080,400	973.90	1,052,201,560	
共和レザー	7,800	595.00	4,641,000	
レゾナック・ホールディングス	167,200	2,313.00	386,733,600	
住友化学	1,283,400	437.80	561,872,520	
住友精化	7,200	4,440.00	31,968,000	
日産化学	81,700	6,222.00	508,337,400	
ラサ工業	6,700	2,109.00	14,130,300	

クレハ	14,800	8,290.00	122,692,000	
多木化学	6,700	4,125.00	27,637,500	
テイカ	11,600	1,368.00	15,868,800	
石原産業	31,300	1,269.00	39,719,700	
片倉コープアグリ	2,800	1,226.00	3,432,800	
日本曹達	18,600	5,160.00	95,976,000	
東ソー	231,000	1,728.00	399,168,000	
トクヤマ	55,900	2,355.00	131,644,500	
セントラル硝子	27,800	3,060.00	85,068,000	
東亞合成	86,700	1,299.50	112,666,650	
大阪ソーダ	10,400	5,580.00	58,032,000	
関東電化工業	33,500	979.00	32,796,500	
デンカ	62,900	2,734.00	171,968,600	
信越化学工業	1,438,100	4,591.00	6,602,317,100	
日本カーバイド工業	5,100	1,424.00	7,262,400	
堺化学工業	13,200	1,911.00	25,225,200	
第一稀元素化学工業	15,800	973.00	15,373,400	
エア・ウォーター	163,200	1,933.00	315,465,600	
日本酸素ホールディングス	167,800	3,070.00	515,146,000	
日本化学工業	5,800	1,919.00	11,130,200	
東邦アセチレン	2,800	1,416.00	3,964,800	
日本パーカライジング	85,600	1,065.00	91,164,000	
高圧ガス工業	25,100	733.00	18,398,300	
チタン工業	1,600	1,388.00	2,220,800	
四国化成ホールディングス	20,500	1,431.00	29,335,500	
戸田工業	3,900	2,227.00	8,685,300	
ステラ　ケミファ	10,200	3,085.00	31,467,000	
保土谷化学工業	4,900	3,420.00	16,758,000	
日本触媒	26,400	5,357.00	141,424,800	
大日精化工業	12,000	2,138.00	25,656,000	
カネカ	39,500	4,053.00	160,093,500	
三菱瓦斯化学	129,200	2,164.50	279,653,400	
三井化学	142,600	4,152.00	592,075,200	
ＪＳＲ	161,500	4,095.00	661,342,500	
東京応化工業	30,300	8,700.00	263,610,000	
大阪有機化学工業	13,000	2,834.00	36,842,000	
三菱ケミカルグループ	1,167,400	849.40	991,589,560	
ＫＨネオケム	28,800	2,291.00	65,980,800	
ダイセル	240,900	1,296.00	312,206,400	
住友ベークライト	25,600	5,652.00	144,691,200	
積水化学工業	350,700	2,018.00	707,712,600	
日本ゼオン	103,800	1,371.00	142,309,800	

アイカ工業	43,700	3,128.00	136,693,600	
ＵＢＥ	89,200	2,493.50	222,420,200	
積水樹脂	24,000	2,250.00	54,000,000	
タキロンシーアイ	37,800	574.00	21,697,200	
旭有機材	11,500	4,365.00	50,197,500	
ニチバン	10,700	1,892.00	20,244,400	
リケンテクノス	37,300	644.00	24,021,200	
大倉工業	8,000	2,191.00	17,528,000	
積水化成品工業	24,300	446.00	10,837,800	
群栄化学工業	4,100	2,887.00	11,836,700	
タイガースポリマー	6,100	695.00	4,239,500	
ミライアル	4,100	1,600.00	6,560,000	
ダイキアクシス	4,900	715.00	3,503,500	
ダイキョーニシカワ	38,200	785.00	29,987,000	
竹本容器	4,500	825.00	3,712,500	
森六ホールディングス	8,800	2,079.00	18,295,200	
恵和	11,200	1,099.00	12,308,800	
日本化薬	132,100	1,206.50	159,378,650	
カーリットホールディングス	15,500	805.00	12,477,500	
日本精化	9,800	2,986.00	29,262,800	
扶桑化学工業	16,100	4,505.00	72,530,500	
トリケミカル研究所	23,100	2,691.00	62,162,100	
ＡＤＥＫＡ	60,300	2,755.00	166,126,500	
日油	53,500	5,957.00	318,699,500	
新日本理化	18,500	242.00	4,477,000	
ハリマ化成グループ	9,400	874.00	8,215,600	
花王	421,300	5,371.00	2,262,802,300	
第一工業製薬	6,200	1,833.00	11,364,600	
石原ケミカル	7,900	1,645.00	12,995,500	
日華化学	5,400	851.00	4,595,400	
ニイタカ	2,400	2,081.00	4,994,400	
三洋化成工業	10,600	4,215.00	44,679,000	
有機合成薬品工業	9,900	305.00	3,019,500	
大日本塗料	21,100	934.00	19,707,400	
日本ペイントホールディングス	765,500	1,160.00	887,980,000	
関西ペイント	158,500	2,078.50	329,442,250	
神東塗料	11,200	124.00	1,388,800	
中国塗料	28,400	1,175.00	33,370,000	
日本特殊塗料	8,500	1,116.00	9,486,000	
藤倉化成	23,200	457.00	10,602,400	
太陽ホールディングス	26,300	2,670.00	70,221,000	
ＤＩＣ	67,600	2,633.00	177,990,800	

サカタインクス	38,500	1,237.00	47,624,500	
東洋インキＳＣホールディングス	33,900	2,149.00	72,851,100	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	15,400	1,178.00	18,141,200	
富士フイルムホールディングス	332,400	8,271.00	2,749,280,400	
資生堂	361,700	6,272.00	2,268,582,400	
ライオン	207,800	1,343.00	279,075,400	
高砂香料工業	11,700	2,696.00	31,543,200	
マンダム	37,400	1,388.00	51,911,200	
ミルボン	25,700	4,965.00	127,600,500	
ファンケル	75,800	2,560.00	194,048,000	
コーセー	35,200	13,490.00	474,848,000	
コタ	16,000	1,608.00	25,728,000	
シーボン	1,700	1,553.00	2,640,100	
ポーラ・オルビスホールディングス	88,800	2,123.00	188,522,400	
ノエビアホールディングス	15,400	5,470.00	84,238,000	
アジュバンホールディングス	3,300	939.00	3,098,700	
新日本製薬	9,900	1,405.00	13,909,500	
アクシージア	8,800	1,322.00	11,633,600	
エステー	13,400	1,500.00	20,100,000	
アグロ　カネショウ	6,900	1,620.00	11,178,000	
コニシ	28,900	2,207.00	63,782,300	
長谷川香料	33,100	3,440.00	113,864,000	
星光ＰＭＣ	6,900	576.00	3,974,400	
小林製薬	50,400	7,591.00	382,586,400	
荒川化学工業	14,700	996.00	14,641,200	
メック	14,300	3,650.00	52,195,000	
日本高純度化学	4,300	2,556.00	10,990,800	
タカラバイオ	46,700	1,622.00	75,747,400	
ＪＣＵ	19,300	3,315.00	63,979,500	
新田ゼラチン	8,300	738.00	6,125,400	
ＯＡＴアグリオ	5,500	1,951.00	10,730,500	
デクセリアルズ	47,300	3,109.00	147,055,700	
アース製薬	15,700	5,030.00	78,971,000	
北興化学工業	17,400	898.00	15,625,200	
大成ラミック	5,500	2,948.00	16,214,000	
クミアイ化学工業	68,800	1,077.00	74,097,600	
日本農薬	31,800	702.00	22,323,600	
アキレス	10,900	1,445.00	15,750,500	
有沢製作所	28,200	1,104.00	31,132,800	
日東電工	125,700	10,070.00	1,265,799,000	
レック	24,700	845.00	20,871,500	
三光合成	21,800	701.00	15,281,800	

きもと	19,800	193.00	3,821,400	
藤森工業	13,700	3,535.00	48,429,500	
前澤化成工業	11,200	1,500.00	16,800,000	
未来工業	6,200	2,679.00	16,609,800	
ウェーブロックホールディングス	4,000	603.00	2,412,000	
ＪＳＰ	12,200	1,911.00	23,314,200	
エフピコ	32,800	2,882.50	94,546,000	
天馬	14,100	2,562.00	36,124,200	
信越ポリマー	32,000	1,455.00	46,560,000	
東リ	30,200	341.00	10,298,200	
ニフコ	62,500	4,042.00	252,625,000	
バルカー	14,500	3,830.00	55,535,000	
ユニ・チャーム	360,900	5,334.00	1,925,040,600	
ショーエイコーポレーション	3,900	594.00	2,316,600	
協和キリン	209,300	2,601.50	544,493,950	
武田薬品工業	1,533,000	4,408.00	6,757,464,000	
アステラス製薬	1,636,300	2,038.00	3,334,779,400	
住友ファーマ	128,500	667.80	85,812,300	
塩野義製薬	218,400	5,788.00	1,264,099,200	
わかもと製薬	12,600	232.00	2,923,200	
日本新薬	40,800	5,446.00	222,196,800	
中外製薬	542,200	3,828.00	2,075,541,600	
科研製薬	29,700	3,532.00	104,900,400	
エーザイ	210,700	9,247.00	1,948,342,900	
ロート製薬	167,800	3,062.00	513,803,600	
小野薬品工業	334,200	2,517.00	841,181,400	
久光製薬	38,500	3,755.00	144,567,500	
持田製薬	19,900	3,200.00	63,680,000	
参天製薬	315,600	1,186.00	374,301,600	
扶桑薬品工業	5,500	1,977.00	10,873,500	
日本ケミファ	1,300	1,929.00	2,507,700	
ツムラ	54,500	2,659.50	144,942,750	
キッセイ薬品工業	26,800	3,010.00	80,668,000	
生化学工業	33,000	745.00	24,585,000	
栄研化学	28,100	1,544.00	43,386,400	
鳥居薬品	9,300	3,555.00	33,061,500	
ＪＣＲファーマ	58,600	1,221.50	71,579,900	
東和薬品	26,600	1,727.00	45,938,200	
富士製薬工業	12,800	1,125.00	14,400,000	
ゼリア新薬工業	24,000	2,346.00	56,304,000	
そーせいグループ	59,500	1,516.00	90,202,000	
第一三共	1,509,000	4,005.00	6,043,545,000	

杏林製薬	37,600	1,719.00	64,634,400	
大幸薬品	33,700	349.00	11,761,300	
ダイト	12,100	2,203.00	26,656,300	
大塚ホールディングス	396,300	5,181.00	2,053,230,300	
大正製薬ホールディングス	38,500	5,291.00	203,703,500	
ペプチドリーム	84,000	1,947.50	163,590,000	
あすか製薬ホールディングス	17,800	1,433.00	25,507,400	
サワイグループホールディングス	39,600	3,616.00	143,193,600	
日本コークス工業	156,200	118.00	18,431,600	
ニチレキ	20,500	1,901.00	38,970,500	
ユシロ化学工業	9,000	1,064.00	9,576,000	
ビーピー・カストロール	5,200	873.00	4,539,600	
富士石油	35,300	278.00	9,813,400	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,400	1,175.00	5,170,000	
出光興産	192,400	2,881.50	554,400,600	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,938,300	495.00	1,454,458,500	
コスモエネルギーホールディングス	68,500	3,918.00	268,383,000	
横浜ゴム	98,600	3,053.00	301,025,800	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	99,500	1,860.00	185,070,000	
ブリヂストン	553,200	5,730.00	3,169,836,000	
住友ゴム工業	169,900	1,386.00	235,481,400	
藤倉コンポジット	9,500	968.00	9,196,000	
オカモト	9,400	3,885.00	36,519,000	
フコク	9,100	1,433.00	13,040,300	
ニッタ	17,600	3,130.00	55,088,000	
住友理工	33,600	831.00	27,921,600	
三ツ星ベルト	25,300	4,470.00	113,091,000	
バンドー化学	27,400	1,470.00	40,278,000	
日東紡績	19,600	2,311.00	45,295,600	
ＡＧＣ	176,300	4,918.00	867,043,400	
日本板硝子	88,300	635.00	56,070,500	
石塚硝子	2,300	1,599.00	3,677,700	
日本山村硝子	5,300	1,098.00	5,819,400	
日本電気硝子	70,800	2,509.00	177,637,200	
オハラ	8,400	1,416.00	11,894,400	
住友大阪セメント	24,500	3,641.00	89,204,500	
太平洋セメント	110,400	2,763.00	305,035,200	
日本ヒューム	15,500	736.00	11,408,000	
日本コンクリート工業	34,300	328.00	11,250,400	
三谷セキサン	7,300	4,475.00	32,667,500	
アジアパイルホールディングス	27,500	609.00	16,747,500	
東海カーボン	145,500	1,279.00	186,094,500	

日本カーボン	10,000	4,235.00	42,350,000	
東洋炭素	10,900	5,270.00	57,443,000	
ノリタケカンパニーリミテド	8,700	5,500.00	47,850,000	
ＴＯＴＯ	114,400	4,198.00	480,251,200	
日本碍子	201,600	1,687.50	340,200,000	
日本特殊陶業	132,000	2,909.50	384,054,000	
ＭＡＲＵＷＡ	6,400	21,990.00	140,736,000	
品川リフラクトリーズ	4,900	5,730.00	28,077,000	
黒崎播磨	3,600	9,060.00	32,616,000	
ヨータイ	9,500	1,455.00	13,822,500	
東京窯業	13,000	347.00	4,511,000	
ニッカトー	6,400	653.00	4,179,200	
フジミインコーポレーテッド	41,500	3,455.00	143,382,500	
クニミネ工業	4,200	1,012.00	4,250,400	
エーアンドエーマテリアル	2,700	1,111.00	2,999,700	
ニチアス	43,900	2,910.00	127,749,000	
ニチハ	21,800	3,095.00	67,471,000	
日本製鉄	797,900	2,972.00	2,371,358,800	
神戸製鋼所	358,400	1,373.00	492,083,200	
中山製鋼所	36,700	853.00	31,305,100	
合同製鐵	8,900	3,645.00	32,440,500	
ＪＦＥホールディングス	476,200	1,992.50	948,828,500	
東京製鐵	50,100	1,305.00	65,380,500	
共英製鋼	20,300	1,955.00	39,686,500	
大和工業	29,400	6,124.00	180,045,600	
東京鐵鋼	8,500	3,190.00	27,115,000	
大阪製鐵	8,200	1,376.00	11,283,200	
淀川製鋼所	20,300	3,270.00	66,381,000	
中部鋼鈑	14,700	1,913.00	28,121,100	
丸一鋼管	54,300	3,210.00	174,303,000	
モリ工業	3,200	3,400.00	10,880,000	
大同特殊鋼	22,500	5,930.00	133,425,000	
日本高周波鋼業	4,800	359.00	1,723,200	
日本冶金工業	13,000	4,165.00	54,145,000	
山陽特殊製鋼	17,600	2,735.00	48,136,000	
愛知製鋼	10,300	3,175.00	32,702,500	
日本金属	3,000	945.00	2,835,000	
大平洋金属	12,700	1,552.00	19,710,400	
新日本電工	106,500	281.00	29,926,500	
栗本鐵工所	8,500	2,301.00	19,558,500	
虹技	1,700	1,210.00	2,057,000	
三菱製鋼	11,200	1,454.00	16,284,800	

日亜鋼業	14,200	317.00	4,501,400	
日本精線	2,400	4,855.00	11,652,000	
エンビプロ・ホールディングス	9,600	536.00	5,145,600	
シンニッタン	15,100	255.00	3,850,500	
新家工業	3,000	2,349.00	7,047,000	
大紀アルミニウム工業所	25,400	1,467.00	37,261,800	
日本軽金属ホールディングス	48,100	1,457.00	70,081,700	
三井金属鉱業	51,900	3,238.00	168,052,200	
東邦亜鉛	10,600	1,705.00	18,073,000	
三菱マテリアル	118,900	2,496.00	296,774,400	
住友金属鉱山	206,600	4,581.00	946,434,600	
ＤＯＷＡホールディングス	40,100	4,530.00	181,653,000	
古河機械金属	26,200	1,529.00	40,059,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,200	2,990.00	78,338,000	
東邦チタニウム	32,300	1,665.00	53,779,500	
ＵＡＣＪ	25,000	2,707.00	67,675,000	
ＣＫサンエツ	4,300	4,165.00	17,909,500	
古河電気工業	59,400	2,558.00	151,945,200	
住友電気工業	615,400	1,704.00	1,048,641,600	
フジクラ	191,200	1,174.50	224,564,400	
ＳＷＣＣ	20,000	1,929.00	38,580,000	
タツタ電線	36,400	707.00	25,734,800	
カナレ電気	2,200	1,361.00	2,994,200	
平河ヒューテック	10,300	1,571.00	16,181,300	
リョービ	19,000	2,217.00	42,123,000	
アーレスティ	15,500	694.00	10,757,000	
ＡＲＥホールディングス	72,100	1,923.00	138,648,300	
稲葉製作所	9,300	1,613.00	15,000,900	
宮地エンジニアリンググループ	4,900	4,005.00	19,624,500	
トーカロ	47,400	1,448.00	68,635,200	
アルファＣｏ	5,100	1,273.00	6,492,300	
ＳＵＭＣＯ	339,300	1,978.00	671,135,400	
川田テクノロジーズ	4,200	5,770.00	24,234,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	11,900	3,025.00	35,997,500	
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,229.00	4,235,100	
信和	7,700	764.00	5,882,800	
東洋製罐グループホールディングス	106,300	2,112.50	224,558,750	
ホッカンホールディングス	9,600	1,379.00	13,238,400	
コロナ	9,900	906.00	8,969,400	
横河ブリッジホールディングス	22,300	2,572.00	57,355,600	
駒井ハルテック	2,200	1,893.00	4,164,600	
高田機工	1,100	2,711.00	2,982,100	

三和ホールディングス	164,100	1,856.00	304,569,600	
文化シヤッター	51,300	1,082.00	55,506,600	
三協立山	20,400	812.00	16,564,800	
アルインコ	13,600	996.00	13,545,600	
東洋シヤッター	3,200	630.00	2,016,000	
ＬＩＸＩＬ	259,600	1,816.00	471,433,600	
日本フイルコン	9,000	472.00	4,248,000	
ノーリツ	26,200	1,682.00	44,068,400	
長府製作所	17,900	2,494.00	44,642,600	
リンナイ	96,900	3,043.00	294,866,700	
ダイニチ工業	6,900	738.00	5,092,200	
日東精工	25,800	605.00	15,609,000	
三洋工業	1,600	1,990.00	3,184,000	
岡部	28,700	732.00	21,008,400	
ジーテクト	19,900	1,768.00	35,183,200	
東プレ	31,400	1,560.00	48,984,000	
高周波熱錬	27,500	983.00	27,032,500	
東京製綱	10,500	1,162.00	12,201,000	
サンコール	12,300	533.00	6,555,900	
モリテック　スチール	10,200	295.00	3,009,000	
パイオラックス	24,600	2,186.00	53,775,600	
エイチワン	18,300	841.00	15,390,300	
日本発條	157,600	1,030.50	162,406,800	
中央発條	13,200	698.00	9,213,600	
アドバネクス	1,700	997.00	1,694,900	
立川ブラインド工業	8,000	1,246.00	9,968,000	
三益半導体工業	13,800	3,000.00	41,400,000	
日本ドライケミカル	3,300	1,761.00	5,811,300	
日本製鋼所	48,100	2,982.50	143,458,250	
三浦工業	72,900	3,604.00	262,731,600	
タクマ	53,700	1,445.00	77,596,500	
ツガミ	38,900	1,321.00	51,386,900	
オークマ	17,500	7,327.00	128,222,500	
芝浦機械	17,500	4,780.00	83,650,000	
アマダ	278,400	1,392.00	387,532,800	
アイダエンジニアリング	36,000	952.00	34,272,000	
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	3,600	1,389.00	5,000,400	
ＦＵＪＩ	75,800	2,605.00	197,459,000	
牧野フライス製作所	19,300	5,470.00	105,571,000	
オーエスジー	83,400	1,924.00	160,461,600	
ダイジェット工業	1,500	884.00	1,326,000	
旭ダイヤモンド工業	48,900	882.00	43,129,800	

DMG森精機	105,800	2,410.00	254,978,000	
ソディック	46,100	712.00	32,823,200	
ディスコ	84,000	22,525.00	1,892,100,000	
日東工器	8,500	1,921.00	16,328,500	
日進工具	14,600	1,106.00	16,147,600	
パンチ工業	12,400	488.00	6,051,200	
冨士ダイス	6,400	656.00	4,198,400	
豊和工業	7,600	807.00	6,133,200	
東洋機械金属	9,500	682.00	6,479,000	
エンシュウ	3,000	813.00	2,439,000	
島精機製作所	27,800	1,814.00	50,429,200	
オプトラン	25,800	2,265.00	58,437,000	
ＮＣホールディングス	2,800	2,195.00	6,146,000	
イワキポンプ	11,700	1,379.00	16,134,300	
フリュー	18,300	1,282.00	23,460,600	
ヤマシンフィルタ	41,900	300.00	12,570,000	
日阪製作所	17,000	922.00	15,674,000	
やまびこ	28,500	1,552.00	44,232,000	
野村マイクロ・サイエンス	5,900	6,330.00	37,347,000	
平田機工	8,300	8,200.00	68,060,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	19,400	575.00	11,155,000	
マルマエ	7,600	1,765.00	13,414,000	
タツモ	9,600	2,249.00	21,590,400	
ナブテスコ	109,500	3,107.00	340,216,500	
三井海洋開発	21,900	1,527.00	33,441,300	
レオン自動機	18,400	1,400.00	25,760,000	
ＳＭＣ	56,600	76,110.00	4,307,826,000	
ホソカワミクロン	11,200	3,490.00	39,088,000	
ユニオンツール	7,700	3,285.00	25,294,500	
瑞光	12,600	1,169.00	14,729,400	
オイレス工業	24,400	1,930.00	47,092,000	
日精エー・エス・ビー機械	7,000	4,055.00	28,385,000	
サトーホールディングス	24,900	1,905.00	47,434,500	
技研製作所	16,400	1,962.00	32,176,800	
日本エアーテック	8,900	1,212.00	10,786,800	
カワタ	4,000	1,132.00	4,528,000	
日精樹脂工業	13,100	982.00	12,864,200	
オカダアイヨン	4,200	2,306.00	9,685,200	
ワイエイシイホールディングス	5,800	2,700.00	15,660,000	
小松製作所	817,400	3,714.00	3,035,823,600	
住友重機械工業	103,200	3,360.00	346,752,000	
日立建機	69,500	3,887.00	270,146,500	

日工	26,100	659.00	17,199,900	
巴工業	7,500	2,792.00	20,940,000	
井関農機	16,400	1,239.00	20,319,600	
ＴＯＷＡ	17,800	2,460.00	43,788,000	
丸山製作所	2,300	1,947.00	4,478,100	
北川鉄工所	7,000	1,125.00	7,875,000	
ローツェ	9,100	11,620.00	105,742,000	
タカキタ	4,000	479.00	1,916,000	
クボタ	923,200	2,024.00	1,868,556,800	
荏原実業	8,400	2,835.00	23,814,000	
三菱化工機	5,700	2,693.00	15,350,100	
月島ホールディングス	23,700	1,250.00	29,625,000	
帝国電機製作所	12,300	2,607.00	32,066,100	
新東工業	35,400	1,058.00	37,453,200	
澁谷工業	16,400	2,549.00	41,803,600	
アイチ　コーポレーション	24,500	855.00	20,947,500	
小森コーポレーション	40,600	1,003.00	40,721,800	
鶴見製作所	13,400	2,678.00	35,885,200	
日本ギア工業	4,700	368.00	1,729,600	
酒井重工業	2,200	5,120.00	11,264,000	
荏原製作所	71,400	6,823.00	487,162,200	
石井鐵工所	1,600	2,467.00	3,947,200	
酉島製作所	15,100	1,856.00	28,025,600	
北越工業	17,600	1,442.00	25,379,200	
ダイキン工業	208,200	28,745.00	5,984,709,000	
オルガノ	24,000	4,075.00	97,800,000	
トーヨーカネツ	6,700	3,560.00	23,852,000	
栗田工業	97,600	5,392.00	526,259,200	
椿本チエイン	24,800	3,730.00	92,504,000	
大同工業	5,600	740.00	4,144,000	
木村化工機	13,500	698.00	9,423,000	
アネスト岩田	29,700	1,179.00	35,016,300	
ダイフク	269,900	2,934.50	792,021,550	
サムコ	4,700	5,420.00	25,474,000	
加藤製作所	6,500	1,193.00	7,754,500	
油研工業	2,100	2,043.00	4,290,300	
タダノ	92,100	1,117.00	102,875,700	
フジテック	61,200	3,529.00	215,974,800	
ＣＫＤ	48,300	2,250.00	108,675,000	
平和	58,000	2,434.00	141,172,000	
理想科学工業	14,000	2,315.00	32,410,000	
ＳＡＮＫＹＯ	34,300	5,665.00	194,309,500	

日本金銭機械	19,200	1,145.00	21,984,000	
マースグループホールディングス	10,300	2,741.00	28,232,300	
フクシマガリレイ	12,800	4,770.00	61,056,000	
オーイズミ	5,200	498.00	2,589,600	
ダイコク電機	9,600	3,945.00	37,872,000	
竹内製作所	31,700	4,495.00	142,491,500	
アマノ	49,500	2,984.00	147,708,000	
ＪＵＫＩ	27,100	581.00	15,745,100	
ジャノメ	17,800	643.00	11,445,400	
マックス	21,500	2,654.00	57,061,000	
グローリー	41,900	2,790.00	116,901,000	
新晃工業	17,600	2,003.00	35,252,800	
大和冷機工業	26,800	1,370.00	36,716,000	
セガサミーホールディングス	140,200	2,985.50	418,567,100	
日本ピストンリング	4,600	1,693.00	7,787,800	
リケン	6,900	3,280.00	22,632,000	
ＴＰＲ	20,000	1,763.00	35,260,000	
ツバキ・ナカシマ	43,100	813.00	35,040,300	
ホシザキ	112,300	5,056.00	567,788,800	
大豊工業	15,200	896.00	13,619,200	
日本精工	320,500	896.10	287,200,050	
ＮＴＮ	343,900	302.80	104,132,920	
ジェイテクト	155,300	1,312.00	203,753,600	
不二越	12,900	4,150.00	53,535,000	
日本トムソン	42,900	592.00	25,396,800	
ＴＨＫ	100,700	2,828.50	284,829,950	
ユーシン精機	13,900	706.00	9,813,400	
前澤給装工業	12,300	1,120.00	13,776,000	
イーグル工業	19,300	1,772.00	34,199,600	
前澤工業	7,800	804.00	6,271,200	
日本ピラー工業	16,200	4,445.00	72,009,000	
キッツ	64,300	1,066.00	68,543,800	
マキタ	217,000	3,927.00	852,159,000	
三井Ｅ＆Ｓ	82,600	513.00	42,373,800	
日立造船	143,100	919.00	131,508,900	
三菱重工業	305,100	6,529.00	1,991,997,900	
ＩＨＩ	109,900	3,857.00	423,884,300	
スター精密	33,000	1,777.00	58,641,000	
日清紡ホールディングス	142,000	1,203.00	170,826,000	
イビデン	100,100	8,073.00	808,107,300	
コニカミノルタ	390,300	497.40	194,135,220	
ブラザー工業	233,300	2,074.50	483,980,850	

ミネベアミツミ	303,600	2,492.00	756,571,200	
日立製作所	848,300	8,842.00	7,500,668,600	
東芝	335,700	4,504.00	1,511,992,800	
三菱電機	1,802,900	1,997.50	3,601,292,750	
富士電機	106,100	5,945.00	630,764,500	
東洋電機製造	4,400	948.00	4,171,200	
安川電機	206,700	6,003.00	1,240,820,100	
シンフォニアテクノロジー	19,200	1,692.00	32,486,400	
明電舎	26,500	2,044.00	54,166,000	
オリジン	3,000	1,297.00	3,891,000	
山洋電気	7,600	7,480.00	56,848,000	
デンヨー	13,300	1,992.00	26,493,600	
ＰＨＣホールディングス	24,600	1,490.00	36,654,000	
ソシオネクスト	24,500	16,470.00	403,515,000	
東芝テック	26,100	3,900.00	101,790,000	
芝浦メカトロニクス	3,000	22,220.00	66,660,000	
マブチモーター	43,400	3,819.00	165,744,600	
ニデック	424,500	7,463.00	3,168,043,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,400	543.00	7,276,200	
トレックス・セミコンダクター	8,400	2,315.00	19,446,000	
東光高岳	10,700	2,126.00	22,748,200	
ダブル・スコープ	57,100	1,320.00	75,372,000	
ダイヘン	15,800	5,470.00	86,426,000	
ヤーマン	30,500	1,034.00	31,537,000	
ＪＶＣケンウッド	159,700	464.00	74,100,800	
ミマキエンジニアリング	17,000	893.00	15,181,000	
Ｉ－ＰＥＸ	10,000	1,318.00	13,180,000	
大崎電気工業	41,400	543.00	22,480,200	
オムロン	159,900	8,562.00	1,369,063,800	
日東工業	23,500	3,535.00	83,072,500	
ＩＤＥＣ	25,800	3,150.00	81,270,000	
正興電機製作所	5,500	1,050.00	5,775,000	
不二電機工業	3,000	1,182.00	3,546,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	57,400	2,817.00	161,695,800	
サクサホールディングス	2,800	2,188.00	6,126,400	
メルコホールディングス	4,500	3,175.00	14,287,500	
テクノメディカ	4,400	1,965.00	8,646,000	
日本電気	246,700	6,848.00	1,689,401,600	
富士通	173,800	18,010.00	3,130,138,000	
沖電気工業	78,900	881.00	69,510,900	
岩崎通信機	5,900	785.00	4,631,500	
電気興業	7,000	2,316.00	16,212,000	

サンケン電気	16,200	12,180.00	197,316,000	
ナカヨ	2,200	1,157.00	2,545,400	
アイホン	10,600	2,449.00	25,959,400	
ルネサスエレクトロニクス	1,138,300	2,624.50	2,987,468,350	
セイコーエプソン	223,800	2,191.00	490,345,800	
ワコム	133,300	600.00	79,980,000	
アルバック	41,400	5,837.00	241,651,800	
アクセル	5,300	1,666.00	8,829,800	
ＥＩＺＯ	12,800	4,655.00	59,584,000	
日本信号	39,700	1,038.00	41,208,600	
京三製作所	36,500	513.00	18,724,500	
能美防災	23,800	1,740.00	41,412,000	
ホーチキ	13,200	1,733.00	22,875,600	
星和電機	6,100	539.00	3,287,900	
エレコム	41,900	1,492.00	62,514,800	
パナソニック　ホールディングス	2,060,500	1,688.50	3,479,154,250	
シャープ	210,000	786.40	165,144,000	
アンリツ	122,900	1,239.00	152,273,100	
富士通ゼネラル	49,400	3,120.00	154,128,000	
ソニーグループ	1,221,800	12,830.00	15,675,694,000	
ＴＤＫ	276,300	5,321.00	1,470,192,300	
帝国通信工業	8,100	1,638.00	13,267,800	
タムラ製作所	74,800	627.00	46,899,600	
アルプスアルパイン	156,100	1,220.50	190,520,050	
池上通信機	4,300	692.00	2,975,600	
日本電波工業	21,200	1,197.00	25,376,400	
鈴木	9,700	938.00	9,098,600	
メイコー	19,200	2,584.00	49,612,800	
日本トリム	4,000	3,250.00	13,000,000	
ローランド　ディー．ジー．	9,700	3,570.00	34,629,000	
フォスター電機	16,100	911.00	14,667,100	
ＳＭＫ	4,200	2,482.00	10,424,400	
ヨコオ	14,100	1,847.00	26,042,700	
ホシデン	40,900	1,724.00	70,511,600	
ヒロセ電機	28,100	18,295.00	514,089,500	
日本航空電子工業	35,800	3,060.00	109,548,000	
ＴＯＡ	19,800	972.00	19,245,600	
マクセル	35,500	1,588.00	56,374,000	
古野電気	23,000	1,073.00	24,679,000	
スミダコーポレーション	18,900	1,484.00	28,047,600	
アイコム	6,700	2,803.00	18,780,100	
リオン	7,400	1,892.00	14,000,800	

横河電機	190,800	2,642.50	504,189,000	
新電元工業	6,700	3,210.00	21,507,000	
アズビル	120,700	4,419.00	533,373,300	
東亜ディーケーケー	6,700	849.00	5,688,300	
日本光電工業	79,900	3,687.00	294,591,300	
チノー	7,200	2,406.00	17,323,200	
共和電業	12,600	364.00	4,586,400	
日本電子材料	11,400	1,815.00	20,691,000	
堀場製作所	38,500	8,089.00	311,426,500	
アドバンテスト	136,100	19,470.00	2,649,867,000	
小野測器	5,800	465.00	2,697,000	
エスペック	14,000	2,331.00	32,634,000	
キーエンス	172,800	65,390.00	11,299,392,000	
日置電機	9,100	8,880.00	80,808,000	
シスメックス	149,000	9,542.00	1,421,758,000	
日本マイクロニクス	28,600	2,084.00	59,602,400	
メガチップス	14,300	3,705.00	52,981,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	9,500	4,095.00	38,902,500	
澤藤電機	1,900	1,251.00	2,376,900	
原田工業	6,400	820.00	5,248,000	
コーセル	21,100	1,224.00	25,826,400	
イリソ電子工業	16,000	3,995.00	63,920,000	
オプテックスグループ	31,900	1,949.00	62,173,100	
千代田インテグレ	6,200	2,387.00	14,799,400	
レーザーテック	79,200	20,485.00	1,622,412,000	
スタンレー電気	123,000	2,669.50	328,348,500	
ウシオ電機	87,900	1,921.50	168,899,850	
岡谷電機産業	11,700	276.00	3,229,200	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	12,800	622.00	7,961,600	
エノモト	3,600	1,746.00	6,285,600	
日本セラミック	17,700	2,633.00	46,604,100	
遠藤照明	6,300	1,234.00	7,774,200	
古河電池	13,100	1,006.00	13,178,600	
双信電機	6,400	357.00	2,284,800	
山一電機	14,300	2,286.00	32,689,800	
図研	15,100	3,805.00	57,455,500	
日本電子	43,300	4,805.00	208,056,500	
カシオ計算機	128,700	1,175.00	151,222,500	
ファナック	842,200	4,747.00	3,997,923,400	
日本シイエムケイ	37,300	536.00	19,992,800	
エンプラス	5,100	5,400.00	27,540,000	
大真空	21,600	646.00	13,953,600	

ローム	79,900	13,410.00	1,071,459,000	
浜松ホトニクス	138,600	6,838.00	947,746,800	
三井ハイテック	17,900	9,150.00	163,785,000	
新光電気工業	61,200	5,782.00	353,858,400	
京セラ	268,300	7,485.00	2,008,225,500	
太陽誘電	84,200	4,143.00	348,840,600	
村田製作所	523,800	7,954.00	4,166,305,200	
双葉電子工業	33,600	496.00	16,665,600	
北陸電気工業	5,300	1,213.00	6,428,900	
ニチコン	35,500	1,450.00	51,475,000	
日本ケミコン	17,400	1,248.00	21,715,200	
ＫＯＡ	26,300	1,829.00	48,102,700	
市光工業	25,600	522.00	13,363,200	
小糸製作所	207,800	2,496.00	518,668,800	
ミツバ	32,400	818.00	26,503,200	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	29,500	15,385.00	453,857,500	
キヤノン電子	19,300	1,908.00	36,824,400	
キヤノン	947,600	3,735.00	3,539,286,000	
リコー	433,000	1,218.50	527,610,500	
象印マホービン	51,800	2,098.00	108,676,400	
ＭＵＴＯＨホールディングス	2,000	1,777.00	3,554,000	
東京エレクトロン	365,500	19,900.00	7,273,450,000	
イノテック	11,700	1,612.00	18,860,400	
トヨタ紡織	72,800	2,544.50	185,239,600	
芦森工業	2,500	1,891.00	4,727,500	
ユニプレス	31,100	1,131.00	35,174,100	
豊田自動織機	126,300	10,085.00	1,273,735,500	
モリタホールディングス	30,400	1,531.00	46,542,400	
三櫻工業	26,500	846.00	22,419,000	
デンソー	356,200	9,453.00	3,367,158,600	
東海理化電機製作所	48,700	2,127.00	103,584,900	
川崎重工業	130,100	3,670.00	477,467,000	
名村造船所	34,500	602.00	20,769,000	
日本車輌製造	6,600	1,991.00	13,140,600	
三菱ロジスネクスト	27,600	1,207.00	33,313,200	
近畿車輛	1,900	1,634.00	3,104,600	
日産自動車	2,453,500	581.90	1,427,691,650	
いすゞ自動車	502,100	1,742.50	874,909,250	
トヨタ自動車	9,483,700	2,260.00	21,433,162,000	
日野自動車	222,700	596.00	132,729,200	
三菱自動車工業	673,800	499.10	336,293,580	
エフテック	9,400	933.00	8,770,200	

レシップホールディングス	5,300	540.00	2,862,000	
GMB	2,700	1,541.00	4,160,700	
ファルテック	2,300	612.00	1,407,600	
武蔵精密工業	42,200	1,753.00	73,976,600	
日産車体	30,500	939.00	28,639,500	
新明和工業	54,300	1,323.00	71,838,900	
極東開発工業	28,500	1,714.00	48,849,000	
トピー工業	14,000	2,289.00	32,046,000	
ティラド	4,400	1,837.00	8,082,800	
曙ブレーキ工業	105,400	144.00	15,177,600	
タチエス	27,400	1,555.00	42,607,000	
ＮＯＫ	67,100	2,068.00	138,762,800	
フタバ産業	46,400	545.00	25,288,000	
ＫＹＢ	16,600	4,965.00	82,419,000	
大同メタル工業	33,900	546.00	18,509,400	
プレス工業	77,300	617.00	47,694,100	
ミクニ	15,600	507.00	7,909,200	
太平洋工業	39,700	1,307.00	51,887,900	
アイシン	133,200	4,527.00	602,996,400	
マツダ	571,300	1,346.50	769,255,450	
今仙電機製作所	8,600	647.00	5,564,200	
本田技研工業	1,403,900	4,217.00	5,920,246,300	
スズキ	317,200	5,362.00	1,700,826,400	
ＳＵＢＡＲＵ	546,500	2,565.00	1,401,772,500	
安永	5,900	956.00	5,640,400	
ヤマハ発動機	271,400	4,033.00	1,094,556,200	
ＴＢＫ	13,500	408.00	5,508,000	
エクセディ	28,300	2,394.00	67,750,200	
豊田合成	50,400	2,769.00	139,557,600	
愛三工業	28,600	1,145.00	32,747,000	
盟和産業	2,000	1,015.00	2,030,000	
日本プラスト	10,700	460.00	4,922,000	
ヨロズ	16,300	935.00	15,240,500	
エフ・シー・シー	30,600	1,885.00	57,681,000	
シマノ	70,100	23,675.00	1,659,617,500	
テイ・エス　テック	79,100	1,837.50	145,346,250	
ジャムコ	7,300	1,531.00	11,176,300	
テルモ	531,200	4,296.00	2,282,035,200	
クリエートメディック	4,400	882.00	3,880,800	
日機装	40,300	880.00	35,464,000	
日本エム・ディ・エム	10,300	978.00	10,073,400	
島津製作所	210,400	4,375.00	920,500,000	

ＪＭＳ	16,000	569.00	9,104,000	
長野計器	12,600	2,118.00	26,686,800	
ブイ・テクノロジー	8,500	2,403.00	20,425,500	
東京計器	13,300	1,301.00	17,303,300	
愛知時計電機	6,700	1,560.00	10,452,000	
インターアクション	8,200	1,415.00	11,603,000	
オーバル	11,900	401.00	4,771,900	
東京精密	37,900	7,740.00	293,346,000	
マニー	69,100	1,637.00	113,116,700	
ニコン	249,700	1,810.00	451,957,000	
トプコン	90,900	2,035.50	185,026,950	
オリンパス	1,063,100	2,221.50	2,361,676,650	
理研計器	10,700	5,500.00	58,850,000	
タムロン	12,900	3,920.00	50,568,000	
ＨＯＹＡ	365,900	16,025.00	5,863,547,500	
シード	6,900	576.00	3,974,400	
ノーリツ鋼機	16,400	2,256.00	36,998,400	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	25,200	1,778.00	44,805,600	
朝日インテック	193,000	2,720.00	524,960,000	
シチズン時計	189,900	879.00	166,922,100	
リズム	4,200	1,558.00	6,543,600	
大研医器	10,100	510.00	5,151,000	
メニコン	59,400	2,417.00	143,569,800	
シンシア	1,300	575.00	747,500	
松風	7,800	2,231.00	17,401,800	
セイコーグループ	26,800	2,619.00	70,189,200	
ニプロ	144,000	1,010.00	145,440,000	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	19,900	183.00	3,641,700	
中本パックス	4,100	1,679.00	6,883,900	
スノーピーク	29,600	1,787.00	52,895,200	
パラマウントベッドホールディングス	39,900	2,290.00	91,371,000	
トランザクション	11,400	1,855.00	21,147,000	
粧美堂	3,600	428.00	1,540,800	
ニホンフラッシュ	16,200	951.00	15,406,200	
前田工繊	14,600	3,020.00	44,092,000	
永大産業	14,300	218.00	3,117,400	
アートネイチャー	17,800	767.00	13,652,600	
バンダイナムコホールディングス	473,200	3,110.00	1,471,652,000	
アイフィスジャパン	3,700	615.00	2,275,500	
ＳＨＯＥＩ	39,000	2,559.00	99,801,000	
フランスベッドホールディングス	19,800	1,140.00	22,572,000	
パイロットコーポレーション	27,000	4,573.00	123,471,000	

萩原工業	11,500	1,498.00	17,227,000	
フジシールインターナショナル	35,000	1,518.00	53,130,000	
タカラトミー	79,400	1,752.00	139,108,800	
広済堂ホールディングス	9,000	2,252.00	20,268,000	
エステールホールディングス	3,100	626.00	1,940,600	
タカノ	5,000	826.00	4,130,000	
プロネクサス	14,300	1,003.00	14,342,900	
ホクシン	10,300	145.00	1,493,500	
ウッドワン	4,400	1,240.00	5,456,000	
大建工業	10,500	2,296.00	24,108,000	
凸版印刷	212,300	3,058.00	649,213,400	
大日本印刷	188,800	3,965.00	748,592,000	
共同印刷	4,900	3,170.00	15,533,000	
ＮＩＳＳＨＡ	32,800	1,702.00	55,825,600	
光村印刷	1,100	1,214.00	1,335,400	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	11,000	2,311.00	25,421,000	
アシックス	159,400	4,248.00	677,131,200	
ツツミ	3,000	2,305.00	6,915,000	
ローランド	12,700	4,100.00	52,070,000	
小松ウオール工業	6,300	2,651.00	16,701,300	
ヤマハ	108,900	5,253.00	572,051,700	
河合楽器製作所	4,700	3,525.00	16,567,500	
クリナップ	19,300	728.00	14,050,400	
ピジョン	110,000	2,021.00	222,310,000	
キングジム	15,200	877.00	13,330,400	
リンテック	34,700	2,305.00	79,983,500	
イトーキ	35,400	1,041.00	36,851,400	
任天堂	1,090,400	6,305.00	6,874,972,000	
三菱鉛筆	24,500	1,687.00	41,331,500	
タカラスタンダード	31,800	1,877.00	59,688,600	
コクヨ	83,200	2,010.00	167,232,000	
ナカバヤシ	18,600	511.00	9,504,600	
グローブライド	14,000	2,223.00	31,122,000	
オカムラ	52,000	1,949.00	101,348,000	
美津濃	17,200	3,695.00	63,554,000	
東京電力ホールディングス	1,556,900	515.30	802,270,570	
中部電力	636,400	1,703.50	1,084,107,400	
関西電力	666,900	1,762.00	1,175,077,800	
中国電力	275,100	965.90	265,719,090	
北陸電力	163,000	761.10	124,059,300	
東北電力	422,200	883.50	373,013,700	
四国電力	147,400	970.50	143,051,700	

九州電力	398,100	906.60	360,917,460	
北海道電力	166,900	574.50	95,884,050	
沖縄電力	40,400	1,148.00	46,379,200	
電源開発	130,100	2,159.50	280,950,950	
エフオン	11,200	540.00	6,048,000	
イーレックス	30,700	1,128.00	34,629,600	
レノバ	46,000	1,505.00	69,230,000	
東京瓦斯	365,100	3,112.00	1,136,191,200	
大阪瓦斯	349,900	2,132.00	745,986,800	
東邦瓦斯	68,000	2,437.50	165,750,000	
北海道瓦斯	10,300	2,302.00	23,710,600	
広島ガス	36,400	370.00	13,468,000	
西部ガスホールディングス	16,200	2,023.00	32,772,600	
静岡ガス	39,400	1,062.00	41,842,800	
メタウォーター	20,700	1,792.00	37,094,400	
ＳＢＳホールディングス	15,400	3,260.00	50,204,000	
東武鉄道	189,700	3,649.00	692,215,300	
相鉄ホールディングス	57,100	2,488.50	142,093,350	
東急	484,300	1,692.00	819,435,600	
京浜急行電鉄	195,900	1,297.00	254,082,300	
小田急電鉄	261,800	1,877.50	491,529,500	
京王電鉄	91,300	4,283.00	391,037,900	
京成電鉄	111,400	5,818.00	648,125,200	
富士急行	21,300	5,370.00	114,381,000	
東日本旅客鉄道	292,900	7,836.00	2,295,164,400	
西日本旅客鉄道	220,600	5,826.00	1,285,215,600	
東海旅客鉄道	133,100	17,595.00	2,341,894,500	
西武ホールディングス	208,900	1,491.50	311,574,350	
鴻池運輸	29,400	1,742.00	51,214,800	
西日本鉄道	46,100	2,449.00	112,898,900	
ハマキョウレックス	13,500	3,755.00	50,692,500	
サカイ引越センター	8,200	4,990.00	40,918,000	
近鉄グループホールディングス	172,400	4,713.00	812,521,200	
阪急阪神ホールディングス	229,900	4,584.00	1,053,861,600	
南海電気鉄道	82,400	3,063.00	252,391,200	
京阪ホールディングス	95,000	3,676.00	349,220,000	
神戸電鉄	4,700	2,972.00	13,968,400	
名古屋鉄道	190,600	2,246.00	428,087,600	
山陽電気鉄道	13,000	2,182.00	28,366,000	
アルプス物流	13,700	1,551.00	21,248,700	
ヤマトホールディングス	220,800	2,598.50	573,748,800	
山九	43,900	4,776.00	209,666,400	

丸運	6,500	240.00	1,560,000	
丸全昭和運輸	10,700	3,960.00	42,372,000	
センコーグループホールディングス	91,300	1,017.00	92,852,100	
トナミホールディングス	3,800	4,870.00	18,506,000	
ニッコンホールディングス	55,200	2,857.00	157,706,400	
日本石油輸送	1,400	2,836.00	3,970,400	
福山通運	13,100	3,970.00	52,007,000	
セイノーホールディングス	107,300	2,146.00	230,265,800	
エスライングループ本社	3,800	876.00	3,328,800	
神奈川中央交通	4,900	3,125.00	15,312,500	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	41,600	2,016.00	83,865,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	16,600	1,242.00	20,617,200	
九州旅客鉄道	121,900	3,085.00	376,061,500	
ＳＧホールディングス	330,900	2,070.50	685,128,450	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	64,400	8,069.00	519,643,600	
日本郵船	461,600	3,260.00	1,504,816,000	
商船三井	304,300	3,581.00	1,089,698,300	
川崎汽船	129,800	3,801.00	493,369,800	
ＮＳユナイテッド海運	9,600	3,500.00	33,600,000	
飯野海運	64,500	874.00	56,373,000	
共栄タンカー	3,700	857.00	3,170,900	
乾汽船	22,700	1,282.00	29,101,400	
日本航空	423,500	3,117.00	1,320,049,500	
ＡＮＡホールディングス	469,200	3,396.00	1,593,403,200	
パスコ	2,600	1,826.00	4,747,600	
トランコム	5,000	6,900.00	34,500,000	
日新	13,100	2,501.00	32,763,100	
三菱倉庫	37,100	3,456.00	128,217,600	
三井倉庫ホールディングス	16,100	3,490.00	56,189,000	
住友倉庫	46,500	2,372.00	110,298,000	
澁澤倉庫	6,900	2,796.00	19,292,400	
東陽倉庫	17,800	270.00	4,806,000	
日本トランスシティ	34,700	630.00	21,861,000	
ケイヒン	2,400	1,777.00	4,264,800	
中央倉庫	8,300	1,080.00	8,964,000	
川西倉庫	2,200	1,036.00	2,279,200	
安田倉庫	11,800	992.00	11,705,600	
ファイズホールディングス	2,400	1,184.00	2,841,600	
東洋埠頭	3,800	1,379.00	5,240,200	
上組	82,700	3,222.00	266,459,400	
サンリツ	3,000	744.00	2,232,000	
キムラユニティー	6,400	1,298.00	8,307,200	

キユーソー流通システム	8,000	927.00	7,416,000	
東海運	7,800	288.00	2,246,400	
エーアイテイー	10,800	1,845.00	19,926,000	
内外トランスライン	6,200	2,554.00	15,834,800	
日本コンセプト	5,400	1,917.00	10,351,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	57,900	1,922.00	111,283,800	
クロスキャット	9,900	1,121.00	11,097,900	
システナ	291,400	283.00	82,466,200	
デジタルアーツ	11,000	5,690.00	62,590,000	
日鉄ソリューションズ	29,600	3,885.00	114,996,000	
キューブシステム	10,300	1,192.00	12,277,600	
コア	7,700	1,717.00	13,220,900	
手間いらず	2,900	3,815.00	11,063,500	
ラクーンホールディングス	14,400	690.00	9,936,000	
ソリトンシステムズ	9,000	1,211.00	10,899,000	
ソフトクリエイトホールディングス	14,300	1,719.00	24,581,700	
ＴＩＳ	189,500	3,569.00	676,325,500	
ＪＮＳホールディングス	6,200	566.00	3,509,200	
グリー	46,500	614.00	28,551,000	
GMOペパボ	2,500	1,731.00	4,327,500	
コーエーテクモホールディングス	108,600	2,339.50	254,069,700	
三菱総合研究所	8,500	5,320.00	45,220,000	
電算	1,600	1,596.00	2,553,600	
ＡＧＳ	5,700	734.00	4,183,800	
ファインデックス	13,800	605.00	8,349,000	
ブレインパッド	13,000	950.00	12,350,000	
ＫＬａｂ	34,500	323.00	11,143,500	
ポールトゥウィンホールディングス	29,600	742.00	21,963,200	
ネクソン	441,200	2,596.00	1,145,355,200	
アイスタイル	50,400	522.00	26,308,800	
エムアップホールディングス	21,300	1,142.00	24,324,600	
エイチーム	10,300	704.00	7,251,200	
エニグモ	22,200	406.00	9,013,200	
テクノスジャパン	11,100	665.00	7,381,500	
コロプラ	67,300	632.00	42,533,600	
ブロードリーフ	101,300	434.00	43,964,200	
クロス・マーケティンググループ	8,200	825.00	6,765,000	
デジタルハーツホールディングス	10,800	1,275.00	13,770,000	
システム情報	13,800	756.00	10,432,800	
メディアドゥ	6,900	1,456.00	10,046,400	
じげん	50,600	749.00	37,899,400	
ブイキューブ	20,900	467.00	9,760,300	

エンカレッジ・テクノロジ	3,200	511.00	1,635,200	
サイバーリンクス	4,400	732.00	3,220,800	
フィックスターズ	19,600	1,404.00	27,518,400	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	8,200	1,222.00	10,020,400	
オプティム	14,300	969.00	13,856,700	
セレス	7,000	1,013.00	7,091,000	
ＳＨＩＦＴ	11,500	25,375.00	291,812,500	
ティーガイア	18,100	1,726.00	31,240,600	
セック	1,900	3,095.00	5,880,500	
テクマトリックス	31,700	1,726.00	54,714,200	
プロシップ	7,600	1,374.00	10,442,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	50,700	2,655.00	134,608,500	
GMOペイメントゲートウェイ	34,600	10,620.00	367,452,000	
ザッパラス	3,800	343.00	1,303,400	
システムリサーチ	5,400	2,652.00	14,320,800	
インターネットイニシアティブ	94,600	2,561.00	242,270,600	
さくらインターネット	19,500	1,199.00	23,380,500	
ヴィンクス	4,000	1,327.00	5,308,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,300	3,010.00	15,953,000	
ＳＲＡホールディングス	8,900	3,165.00	28,168,500	
システムインテグレータ	4,100	439.00	1,799,900	
朝日ネット	18,700	643.00	12,024,100	
ｅＢＡＳＥ	24,400	713.00	17,397,200	
アバントグループ	21,900	1,389.00	30,419,100	
アドソル日進	7,300	1,653.00	12,066,900	
ＯＤＫソリューションズ	3,100	561.00	1,739,100	
フリービット	9,100	1,328.00	12,084,800	
コムチュア	22,900	1,939.00	44,403,100	
サイバーコム	2,200	1,402.00	3,084,400	
アステリア	13,600	792.00	10,771,200	
アイル	8,100	2,692.00	21,805,200	
マークラインズ	9,400	2,435.00	22,889,000	
メディカル・データ・ビジョン	25,900	708.00	18,337,200	
ｇｕｍｉ	25,600	703.00	17,996,800	
ショーケース	3,200	387.00	1,238,400	
モバイルファクトリー	2,900	843.00	2,444,700	
テラスカイ	7,500	2,575.00	19,312,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,000	1,571.00	15,710,000	
ＰＣＩホールディングス	5,200	1,154.00	6,000,800	
アイビーシー	2,200	581.00	1,278,200	
ネオジャパン	5,800	1,055.00	6,119,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	4,400	1,439.00	6,331,600	

ラクス	82,000	2,270.00	186,140,000	
ランドコンピュータ	3,300	1,262.00	4,164,600	
ダブルスタンダード	7,000	2,420.00	16,940,000	
オープンドア	12,200	1,263.00	15,408,600	
アカツキ	8,200	2,025.00	16,605,000	
ベネフィットジャパン	800	1,219.00	975,200	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	5,400	1,466.00	7,916,400	
カナミックネットワーク	18,800	452.00	8,497,600	
ノムラシステムコーポレーション	13,000	124.00	1,612,000	
チェンジホールディングス	42,400	2,137.00	90,608,800	
シンクロ・フード	8,600	683.00	5,873,800	
オークネット	8,600	1,732.00	14,895,200	
キャピタル・アセット・プランニング	2,700	811.00	2,189,700	
セグエグループ	3,800	1,082.00	4,111,600	
エイトレッド	2,100	1,434.00	3,011,400	
マクロミル	34,000	808.00	27,472,000	
ビーグリー	2,300	1,113.00	2,559,900	
オロ	5,200	1,933.00	10,051,600	
ユーザーローカル	6,300	2,415.00	15,214,500	
テモナ	3,300	296.00	976,800	
ニーズウェル	7,400	775.00	5,735,000	
マネーフォワード	41,900	5,550.00	232,545,000	
サインポスト	5,200	537.00	2,792,400	
Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ	12,300	1,182.00	14,538,600	
電算システムホールディングス	8,400	3,105.00	26,082,000	
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	65,700	1,658.00	108,930,600	
ソルクシーズ	11,000	427.00	4,697,000	
フェイス	3,800	511.00	1,941,800	
プロトコーポレーション	21,700	1,189.00	25,801,300	
ハイマックス	5,400	1,398.00	7,549,200	
野村総合研究所	345,100	3,841.00	1,325,529,100	
サイバネットシステム	14,600	825.00	12,045,000	
ＣＥホールディングス	7,000	651.00	4,557,000	
日本システム技術	5,600	2,413.00	13,512,800	
インテージホールディングス	19,600	1,628.00	31,908,800	
東邦システムサイエンス	3,800	1,208.00	4,590,400	
ソースネクスト	88,300	192.00	16,953,600	
インフォコム	22,300	2,230.00	49,729,000	
シンプレクス・ホールディングス	29,600	2,579.00	76,338,400	
ＨＥＲＯＺ	5,800	2,053.00	11,907,400	
ラクスル	41,600	1,492.00	62,067,200	
メルカリ	104,300	3,428.00	357,540,400	

ＩＰＳ	5,600	2,302.00	12,891,200	
ＦＩＧ	15,700	276.00	4,333,200	
システムサポート	6,700	2,024.00	13,560,800	
イーソル	11,100	856.00	9,501,600	
アルテリア・ネットワークス	16,200	1,976.00	32,011,200	
東海ソフト	2,000	1,112.00	2,224,000	
ウイングアーク１ｓｔ	17,900	2,269.00	40,615,100	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,489.00	6,998,300	
サーバーワークス	3,500	2,885.00	10,097,500	
東名	1,000	2,686.00	2,686,000	
ヴィッツ	1,400	1,451.00	2,031,400	
トビラシステムズ	3,400	933.00	3,172,200	
Ｓａｎｓａｎ	56,700	1,547.50	87,743,250	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,300	1,011.00	3,336,300	
ギフティ	18,900	1,764.00	33,339,600	
メドレー	23,300	5,160.00	120,228,000	
ベース	5,900	5,240.00	30,916,000	
ＪＭＤＣ	28,500	5,396.00	153,786,000	
フォーカスシステムズ	12,700	1,022.00	12,979,400	
クレスコ	13,400	1,950.00	26,130,000	
フジ・メディア・ホールディングス	166,400	1,533.50	255,174,400	
オービック	57,900	22,515.00	1,303,618,500	
ジャストシステム	24,900	3,989.00	99,326,100	
ＴＤＣソフト	14,600	1,745.00	25,477,000	
Ｚホールディングス	2,465,300	369.20	910,188,760	
トレンドマイクロ	100,100	6,781.00	678,778,100	
ＩＤホールディングス	11,700	1,260.00	14,742,000	
日本オラクル	33,100	9,963.00	329,775,300	
アルファシステムズ	5,500	3,305.00	18,177,500	
フューチャー	43,100	1,733.00	74,692,300	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	10,600	1,672.00	17,723,200	
ＳＢテクノロジー	7,400	2,647.00	19,587,800	
トーセ	3,900	762.00	2,971,800	
オービックビジネスコンサルタント	34,100	5,180.00	176,638,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	93,000	3,498.00	325,314,000	
アイティフォー	22,900	1,076.00	24,640,400	
東計電算	2,400	6,050.00	14,520,000	
エックスネット	1,900	1,018.00	1,934,200	
大塚商会	98,200	5,501.00	540,198,200	
サイボウズ	23,900	2,239.00	53,512,100	
電通国際情報サービス	21,100	5,120.00	108,032,000	
ＡＣＣＥＳＳ	20,500	928.00	19,024,000	

デジタルガレージ	30,800	4,095.00	126,126,000	
EMシステムズ	28,900	825.00	23,842,500	
ウェザーニューズ	5,400	6,660.00	35,964,000	
ＣＩＪ	28,800	555.00	15,984,000	
ビジネスエンジニアリング	2,900	3,030.00	8,787,000	
日本エンタープライズ	14,300	142.00	2,030,600	
WOWOW	13,100	1,132.00	14,829,200	
スカラ	16,100	743.00	11,962,300	
インテリジェント　ウェイブ	7,200	748.00	5,385,600	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	14,500	678.00	9,831,000	
ネットワンシステムズ	64,600	2,966.00	191,603,600	
システムソフト	60,900	78.00	4,750,200	
アルゴグラフィックス	15,900	3,710.00	58,989,000	
マーベラス	28,200	671.00	18,922,200	
エイベックス	29,500	1,565.00	46,167,500	
ＢＩＰＲＯＧＹ	63,800	3,405.00	217,239,000	
都築電気	9,100	1,879.00	17,098,900	
ＴＢＳホールディングス	88,700	2,624.50	232,793,150	
日本テレビホールディングス	153,400	1,339.00	205,402,600	
朝日放送グループホールディングス	16,300	665.00	10,839,500	
テレビ朝日ホールディングス	42,100	1,697.00	71,443,700	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	153,800	573.00	88,127,400	
テレビ東京ホールディングス	12,500	3,410.00	42,625,000	
日本ＢＳ放送	4,900	926.00	4,537,400	
ビジョン	22,800	1,704.00	38,851,200	
スマートバリュー	3,400	385.00	1,309,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	19,400	3,380.00	65,572,000	
ワイヤレスゲート	6,100	226.00	1,378,600	
日本通信	160,100	244.00	39,064,400	
クロップス	2,200	1,020.00	2,244,000	
日本電信電話	55,489,800	166.90	9,261,247,620	
ＫＤＤＩ	1,338,600	4,307.00	5,765,350,200	
ソフトバンク	2,783,700	1,530.50	4,260,452,850	
光通信	20,400	20,460.00	417,384,000	
エムティーアイ	12,000	556.00	6,672,000	
GMOインターネットグループ	64,000	2,712.50	173,600,000	
ファイバーゲート	9,300	1,422.00	13,224,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,200	273.00	873,600	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	91,600	3,390.00	310,524,000	
学研ホールディングス	28,900	870.00	25,143,000	
ゼンリン	29,700	929.00	27,591,300	
昭文社ホールディングス	5,900	300.00	1,770,000	

インプレスホールディングス	12,000	225.00	2,700,000	
アイネット	10,500	1,640.00	17,220,000	
松竹	9,900	10,650.00	105,435,000	
東宝	108,400	5,408.00	586,227,200	
東映	4,800	17,860.00	85,728,000	
ＮＴＴデータグループ	543,500	1,913.00	1,039,715,500	
ピー・シー・エー	10,000	1,402.00	14,020,000	
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,261.00	16,731,400	
ＤＴＳ	36,900	3,220.00	118,818,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	87,100	6,400.00	557,440,000	
シーイーシー	24,300	1,739.00	42,257,700	
カプコン	172,100	5,557.00	956,359,700	
アイ・エス・ビー	8,900	1,561.00	13,892,900	
ジャステック	10,700	1,351.00	14,455,700	
ＳＣＳＫ	141,400	2,221.50	314,120,100	
ＮＳＷ	6,800	2,362.00	16,061,600	
アイネス	12,200	1,463.00	17,848,600	
ＴＫＣ	27,600	3,735.00	103,086,000	
富士ソフト	39,200	4,485.00	175,812,000	
ＮＳＤ	61,800	2,756.00	170,320,800	
コナミグループ	74,200	7,349.00	545,295,800	
福井コンピュータホールディングス	12,100	2,664.00	32,234,400	
ＪＢＣＣホールディングス	12,600	2,432.00	30,643,200	
ミロク情報サービス	15,800	1,583.00	25,011,400	
ソフトバンクグループ	854,500	6,767.00	5,782,401,500	
高千穂交易	5,100	3,150.00	16,065,000	
オルバヘルスケアホールディングス	2,100	1,750.00	3,675,000	
伊藤忠食品	4,100	5,130.00	21,033,000	
エレマテック	16,400	1,809.00	29,667,600	
あらた	14,000	4,820.00	67,480,000	
トーメンデバイス	2,600	4,900.00	12,740,000	
東京エレクトロン　デバイス	6,700	10,080.00	67,536,000	
円谷フィールズホールディングス	31,400	2,879.00	90,400,600	
双日	182,100	3,187.00	580,352,700	
アルフレッサ　ホールディングス	183,400	2,138.50	392,200,900	
横浜冷凍	49,800	1,175.00	58,515,000	
ラサ商事	6,500	1,458.00	9,477,000	
アルコニックス	24,100	1,380.00	33,258,000	
神戸物産	141,400	3,584.00	506,777,600	
ハイパー	2,800	446.00	1,248,800	
あい　ホールディングス	29,300	2,242.00	65,690,600	
ディーブイエックス	3,900	875.00	3,412,500	

ダイワボウホールディングス	74,700	2,690.50	200,980,350	
マクニカホールディングス	43,200	5,710.00	246,672,000	
ラクト・ジャパン	7,100	2,044.00	14,512,400	
グリムス	7,600	2,916.00	22,161,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,700	919.00	24,537,300	
八洲電機	14,800	1,341.00	19,846,800	
メディアスホールディングス	11,700	806.00	9,430,200	
レスターホールディングス	17,500	2,356.00	41,230,000	
ジューテックホールディングス	3,300	1,181.00	3,897,300	
大光	6,000	595.00	3,570,000	
ＯＣＨＩホールディングス	3,300	1,309.00	4,319,700	
ＴＯＫＡＩホールディングス	90,300	894.00	80,728,200	
黒谷	3,900	614.00	2,394,600	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,800	849.00	2,377,200	
三洋貿易	20,600	1,353.00	27,871,800	
ビューティガレージ	2,900	4,550.00	13,195,000	
ウイン・パートナーズ	13,300	1,048.00	13,938,400	
ミタチ産業	3,600	1,166.00	4,197,600	
シップヘルスケアホールディングス	65,700	2,326.00	152,818,200	
明治電機工業	6,800	1,464.00	9,955,200	
デリカフーズホールディングス	5,600	590.00	3,304,000	
スターティアホールディングス	2,800	1,311.00	3,670,800	
コメダホールディングス	44,800	2,702.00	121,049,600	
ピーバンドットコム	2,100	464.00	974,400	
アセンテック	6,200	674.00	4,178,800	
富士興産	3,200	1,616.00	5,171,200	
協栄産業	1,300	2,005.00	2,606,500	
フルサト・マルカホールディングス	18,200	2,481.00	45,154,200	
ヤマエグループホールディングス	10,300	2,826.00	29,107,800	
小野建	18,000	1,635.00	29,430,000	
南陽	2,700	2,179.00	5,883,300	
佐鳥電機	8,900	1,631.00	14,515,900	
エコートレーディング	2,800	992.00	2,777,600	
伯東	10,500	5,620.00	59,010,000	
コンドーテック	14,100	1,216.00	17,145,600	
中山福	7,600	345.00	2,622,000	
ナガイレーベン	23,100	2,235.00	51,628,500	
三菱食品	16,900	3,715.00	62,783,500	
松田産業	13,900	2,250.00	31,275,000	
第一興商	70,700	2,671.50	188,875,050	
メディパルホールディングス	174,800	2,289.50	400,204,600	
ＳＰＫ	8,100	1,762.00	14,272,200	

萩原電気ホールディングス	7,200	3,405.00	24,516,000	
アズワン	26,000	5,454.00	141,804,000	
スズデン	6,400	2,217.00	14,188,800	
尾家産業	3,400	1,304.00	4,433,600	
シモジマ	12,600	1,073.00	13,519,800	
ドウシシャ	19,300	2,243.00	43,289,900	
小津産業	3,200	1,573.00	5,033,600	
高速	9,500	2,009.00	19,085,500	
たけびし	7,000	1,711.00	11,977,000	
リックス	2,900	3,105.00	9,004,500	
丸文	16,300	1,246.00	20,309,800	
ハピネット	15,500	2,155.00	33,402,500	
橋本総業ホールディングス	7,200	1,187.00	8,546,400	
日本ライフライン	53,600	981.00	52,581,600	
タカショー	16,000	679.00	10,864,000	
ＩＤＯＭ	55,300	958.00	52,977,400	
進和	11,200	2,391.00	26,779,200	
エスケイジャパン	3,500	546.00	1,911,000	
ダイトロン	7,200	2,940.00	21,168,000	
シークス	26,100	1,516.00	39,567,600	
田中商事	4,000	647.00	2,588,000	
オーハシテクニカ	8,900	1,554.00	13,830,600	
白銅	6,600	2,281.00	15,054,600	
ダイコー通産	1,500	1,154.00	1,731,000	
伊藤忠商事	1,126,000	5,524.00	6,220,024,000	
丸紅	1,426,000	2,395.00	3,415,270,000	
高島	2,200	3,470.00	7,634,000	
長瀬産業	83,800	2,384.00	199,779,200	
蝶理	9,800	3,020.00	29,596,000	
豊田通商	160,100	7,246.00	1,160,084,600	
三共生興	26,300	577.00	15,175,100	
兼松	70,900	2,004.00	142,083,600	
ツカモトコーポレーション	2,000	1,351.00	2,702,000	
三井物産	1,296,900	5,157.00	6,688,113,300	
日本紙パルプ商事	9,700	4,640.00	45,008,000	
カメイ	19,400	1,470.00	28,518,000	
東都水産	800	6,520.00	5,216,000	
ＯＵＧホールディングス	2,100	2,445.00	5,134,500	
スターゼン	13,900	2,288.00	31,803,200	
山善	49,300	1,098.00	54,131,400	
椿本興業	2,900	4,185.00	12,136,500	
住友商事	1,131,700	2,954.00	3,343,041,800	

内田洋行	7,400	5,760.00	42,624,000	
三菱商事	1,114,100	6,862.00	7,644,954,200	
第一実業	6,500	5,310.00	34,515,000	
キヤノンマーケティングジャパン	42,300	3,568.00	150,926,400	
西華産業	7,200	2,017.00	14,522,400	
佐藤商事	12,700	1,438.00	18,262,600	
菱洋エレクトロ	15,600	3,630.00	56,628,000	
東京産業	16,700	881.00	14,712,700	
ユアサ商事	15,700	4,475.00	70,257,500	
神鋼商事	4,600	5,780.00	26,588,000	
トルク	7,700	263.00	2,025,100	
阪和興業	32,800	4,500.00	147,600,000	
正栄食品工業	12,200	4,220.00	51,484,000	
カナデン	12,200	1,286.00	15,689,200	
ＲＹＯＤＥＮ	14,800	2,227.00	32,959,600	
岩谷産業	41,600	7,419.00	308,630,400	
ナイス	3,900	1,477.00	5,760,300	
ニチモウ	1,800	3,965.00	7,137,000	
極東貿易	10,900	1,745.00	19,020,500	
アステナホールディングス	31,700	449.00	14,233,300	
三愛オブリ	48,300	1,506.00	72,739,800	
稲畑産業	36,900	3,130.00	115,497,000	
ＧＳＩクレオス	10,600	1,969.00	20,871,400	
明和産業	24,300	670.00	16,281,000	
クワザワホールディングス	4,600	542.00	2,493,200	
ワキタ	33,600	1,241.00	41,697,600	
東邦ホールディングス	45,500	2,640.50	120,142,750	
サンゲツ	45,900	2,464.00	113,097,600	
ミツウロコグループホールディングス	23,300	1,356.00	31,594,800	
シナネンホールディングス	5,900	3,795.00	22,390,500	
伊藤忠エネクス	45,300	1,274.00	57,712,200	
サンリオ	51,800	6,032.00	312,457,600	
サンワテクノス	9,300	2,332.00	21,687,600	
リョーサン	19,400	4,290.00	83,226,000	
新光商事	24,600	1,156.00	28,437,600	
トーホー	7,800	2,788.00	21,746,400	
三信電気	7,400	2,128.00	15,747,200	
東陽テクニカ	18,600	1,384.00	25,742,400	
モスフードサービス	26,900	3,220.00	86,618,000	
加賀電子	14,800	6,360.00	94,128,000	
ソーダニッカ	10,400	826.00	8,590,400	
立花エレテック	13,300	2,789.00	37,093,700	

フォーバル	7,200	1,069.00	7,696,800	
ＰＡＬＴＡＣ	28,700	4,793.00	137,559,100	
三谷産業	32,000	317.00	10,144,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4,600	4,535.00	20,861,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,057.00	2,468,400	
コーア商事ホールディングス	10,300	648.00	6,674,400	
ＫＰＰグループホールディングス	42,600	634.00	27,008,400	
ヤマタネ	8,100	1,710.00	13,851,000	
丸紅建材リース	1,300	2,482.00	3,226,600	
泉州電業	9,200	3,650.00	33,580,000	
トラスコ中山	38,400	2,231.00	85,670,400	
オートバックスセブン	63,600	1,545.50	98,293,800	
モリト	13,100	1,077.00	14,108,700	
加藤産業	22,600	3,810.00	86,106,000	
北恵	3,200	778.00	2,489,600	
イエローハット	32,300	1,825.00	58,947,500	
ＪＫホールディングス	14,100	987.00	13,916,700	
日伝	10,800	2,425.00	26,190,000	
北沢産業	7,600	366.00	2,781,600	
杉本商事	8,100	2,106.00	17,058,600	
因幡電機産業	47,400	3,130.00	148,362,000	
東テク	6,100	5,300.00	32,330,000	
ミスミグループ本社	275,800	2,801.50	772,653,700	
アルテック	8,000	257.00	2,056,000	
タキヒヨー	3,500	1,090.00	3,815,000	
蔵王産業	2,400	2,356.00	5,654,400	
スズケン	53,500	3,856.00	206,296,000	
ジェコス	11,000	876.00	9,636,000	
グローセル	17,200	415.00	7,138,000	
ローソン	45,400	6,294.00	285,747,600	
サンエー	14,100	4,700.00	66,270,000	
カワチ薬品	14,500	2,185.00	31,682,500	
エービーシー・マート	26,700	7,746.00	206,818,200	
ハードオフコーポレーション	6,000	1,527.00	9,162,000	
アスクル	38,000	2,174.00	82,612,000	
ゲオホールディングス	18,100	1,934.00	35,005,400	
アダストリア	22,200	2,919.00	64,801,800	
くら寿司	21,600	3,070.00	66,312,000	
キャンドゥ	6,700	2,523.00	16,904,100	
ＩＫホールディングス	5,800	373.00	2,163,400	
パルグループホールディングス	18,100	3,850.00	69,685,000	
エディオン	72,700	1,449.00	105,342,300	

サーラコーポレーション	39,000	735.00	28,665,000	
ワッツ	7,600	713.00	5,418,800	
ハローズ	8,400	3,670.00	30,828,000	
あみやき亭	4,600	3,340.00	15,364,000	
大黒天物産	5,700	6,010.00	34,257,000	
ハニーズホールディングス	14,700	1,768.00	25,989,600	
ファーマライズホールディングス	3,900	615.00	2,398,500	
アルペン	15,300	1,976.00	30,232,800	
ハブ	5,300	826.00	4,377,800	
クオールホールディングス	25,400	1,749.00	44,424,600	
ジンズホールディングス	11,000	3,345.00	36,795,000	
ビックカメラ	97,700	1,085.00	106,004,500	
ＤＣＭホールディングス	106,600	1,200.00	127,920,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	259,300	1,827.50	473,870,750	
東京一番フーズ	4,200	504.00	2,116,800	
きちりホールディングス	3,300	837.00	2,762,100	
アークランドサービスホールディングス	15,100	2,908.00	43,910,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	227,500	1,369.50	311,561,250	
ドトール・日レスホールディングス	32,600	2,055.00	66,993,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	110,900	7,995.00	886,645,500	
ブロンコビリー	9,900	2,733.00	27,056,700	
ＺＯＺＯ	120,900	2,853.00	344,927,700	
トレジャー・ファクトリー	9,100	1,838.00	16,725,800	
物語コーポレーション	30,700	3,400.00	104,380,000	
三越伊勢丹ホールディングス	308,000	1,461.00	449,988,000	
Ｈａｍｅｅ	6,800	965.00	6,562,000	
マーケットエンタープライズ	1,800	1,557.00	2,802,600	
ウエルシアホールディングス	95,000	3,102.00	294,690,000	
クリエイトＳＤホールディングス	30,400	3,490.00	106,096,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	18,200	355.00	6,461,000	
ミサワ	3,400	615.00	2,091,000	
ティーライフ	2,200	1,575.00	3,465,000	
チムニー	4,400	1,355.00	5,962,000	
シュッピン	14,000	1,109.00	15,526,000	
オイシックス・ラ・大地	24,800	2,382.00	59,073,600	
ネクステージ	41,800	3,760.00	157,168,000	
ジョイフル本田	53,500	1,647.00	88,114,500	
鳥貴族ホールディングス	7,000	2,622.00	18,354,000	
ホットランド	14,300	1,628.00	23,280,400	
すかいらーくホールディングス	250,100	1,751.00	437,925,100	
ＳＦＰホールディングス	10,000	2,182.00	21,820,000	
綿半ホールディングス	14,500	1,346.00	19,517,000	

ヨシックスホールディングス	3,000	2,511.00	7,533,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	60,000	1,116.00	66,960,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,900	799.00	7,111,100	
ＢＥＥＮＯＳ	8,000	1,989.00	15,912,000	
あさひ	15,700	1,255.00	19,703,500	
日本調剤	12,800	1,211.00	15,500,800	
コスモス薬品	18,100	14,915.00	269,961,500	
トーエル	7,000	740.00	5,180,000	
セブン&アイ・ホールディングス	629,800	6,005.00	3,781,949,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	137,500	980.00	134,750,000	
ツルハホールディングス	38,400	10,760.00	413,184,000	
サンマルクホールディングス	15,000	1,871.00	28,065,000	
フェリシモ	3,700	1,009.00	3,733,300	
トリドールホールディングス	45,600	3,185.00	145,236,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	20,200	346.00	6,989,200	
ウイルプラスホールディングス	2,700	1,191.00	3,215,700	
ＪＭホールディングス	14,000	1,988.00	27,832,000	
サツドラホールディングス	7,100	777.00	5,516,700	
アレンザホールディングス	14,200	996.00	14,143,200	
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,675.00	8,710,000	
バロックジャパンリミテッド	12,400	896.00	11,110,400	
クスリのアオキホールディングス	16,400	8,023.00	131,577,200	
力の源ホールディングス	8,200	2,016.00	16,531,200	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	97,600	2,657.00	259,323,200	
メディカルシステムネットワーク	17,200	364.00	6,260,800	
はるやまホールディングス	7,000	508.00	3,556,000	
ノジマ	60,000	1,372.00	82,320,000	
カッパ・クリエイト	28,700	1,515.00	43,480,500	
ライトオン	10,700	608.00	6,505,600	
良品計画	199,900	1,672.50	334,332,750	
パリミキホールディングス	19,300	327.00	6,311,100	
アドヴァングループ	17,900	993.00	17,774,700	
アルビス	6,200	2,400.00	14,880,000	
コナカ	15,500	403.00	6,246,500	
ハウス　オブ　ローゼ	2,100	1,610.00	3,381,000	
Ｇ－７ホールディングス	23,200	1,248.00	28,953,600	
イオン北海道	27,200	881.00	23,963,200	
コジマ	31,100	602.00	18,722,200	
ヒマラヤ	5,000	958.00	4,790,000	
コーナン商事	24,800	3,500.00	86,800,000	

エコス	7,000	1,879.00	13,153,000	
ワタミ	22,100	893.00	19,735,300	
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	369,000	2,582.00	952,758,000	
西松屋チェーン	40,800	1,635.00	66,708,000	
ゼンショーホールディングス	100,100	6,457.00	646,345,700	
幸楽苑ホールディングス	11,900	1,008.00	11,995,200	
ハークスレイ	5,800	651.00	3,775,800	
サイゼリヤ	27,200	3,565.00	96,968,000	
ＶＴホールディングス	70,300	532.00	37,399,600	
魚力	5,900	2,187.00	12,903,300	
フジ・コーポレーション	10,600	1,654.00	17,532,400	
ユナイテッドアローズ	19,700	2,470.00	48,659,000	
ハイデイ日高	27,300	2,457.00	67,076,100	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	11,100	189.00	2,097,900	
コロワイド	84,200	2,031.00	171,010,200	
ピーシーデポコーポレーション	22,000	478.00	10,516,000	
壱番屋	14,500	5,370.00	77,865,000	
ＰＬＡＮＴ	4,000	725.00	2,900,000	
スギホールディングス	36,900	6,289.00	232,064,100	
薬王堂ホールディングス	10,400	2,536.00	26,374,400	
スクロール	27,700	936.00	25,927,200	
ヨンドシーホールディングス	16,000	1,905.00	30,480,000	
木曽路	27,900	2,422.00	67,573,800	
ＳＲＳホールディングス	30,700	957.00	29,379,900	
千趣会	34,900	393.00	13,715,700	
リテールパートナーズ	27,400	1,559.00	42,716,600	
ケーヨー	29,700	830.00	24,651,000	
上新電機	16,500	1,982.00	32,703,000	
日本瓦斯	97,100	1,961.50	190,461,650	
ロイヤルホールディングス	35,400	2,596.00	91,898,400	
いなげや	17,900	1,481.00	26,509,900	
チヨダ	18,000	898.00	16,164,000	
ライフコーポレーション	16,000	3,305.00	52,880,000	
リンガーハット	23,600	2,488.00	58,716,800	
ＭｒＭａｘＨＤ	26,400	624.00	16,473,600	
ＡＯＫＩホールディングス	34,100	914.00	31,167,400	
オークワ	29,400	835.00	24,549,000	
コメリ	28,300	2,869.00	81,192,700	
青山商事	39,500	1,293.00	51,073,500	
しまむら	21,500	13,280.00	285,520,000	
はせがわ	8,100	376.00	3,045,600	

高島屋	137,900	1,974.50	272,283,550	
松屋	31,100	1,177.00	36,604,700	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	89,100	1,495.00	133,204,500	
近鉄百貨店	8,000	2,468.00	19,744,000	
丸井グループ	134,800	2,452.00	330,529,600	
アクシアル　リテイリング	12,600	3,610.00	45,486,000	
イオン	619,500	2,964.50	1,836,507,750	
イズミ	27,800	3,354.00	93,241,200	
平和堂	30,600	2,347.00	71,818,200	
フジ	28,100	1,765.00	49,596,500	
ヤオコー	20,700	7,259.00	150,261,300	
ゼビオホールディングス	25,200	1,085.00	27,342,000	
ケーズホールディングス	129,600	1,255.00	162,648,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6,200	554.00	3,434,800	
日産東京販売ホールディングス	19,400	380.00	7,372,000	
シルバーライフ	3,800	1,368.00	5,198,400	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	8,100	4,100.00	33,210,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,800	1,030.00	2,884,000	
ブックオフグループホールディングス	9,700	1,320.00	12,804,000	
ギフトホールディングス	4,000	4,635.00	18,540,000	
アインホールディングス	25,300	5,030.00	127,259,000	
元気寿司	5,300	3,360.00	17,808,000	
ヤマダホールディングス	750,500	424.70	318,737,350	
アークランズ	27,100	1,572.00	42,601,200	
ニトリホールディングス	73,900	16,200.00	1,197,180,000	
グルメ杵屋	15,300	1,026.00	15,697,800	
愛眼	10,500	186.00	1,953,000	
ケーユーホールディングス	11,100	1,200.00	13,320,000	
吉野家ホールディングス	71,700	2,583.50	185,236,950	
松屋フーズホールディングス	8,700	4,115.00	35,800,500	
サガミホールディングス	29,800	1,262.00	37,607,600	
関西フードマーケット	16,900	1,434.00	24,234,600	
王将フードサービス	12,100	6,540.00	79,134,000	
ミニストップ	13,400	1,450.00	19,430,000	
アークス	33,700	2,507.00	84,485,900	
バローホールディングス	35,100	2,021.00	70,937,100	
ベルク	9,200	6,380.00	58,696,000	
大庄	8,100	1,154.00	9,347,400	
ファーストリテイリング	82,200	34,650.00	2,848,230,000	
サンドラッグ	69,500	4,204.00	292,178,000	
サックスバー　ホールディングス	17,900	971.00	17,380,900	
ヤマザワ	3,000	1,271.00	3,813,000	

やまや	3,100	2,702.00	8,376,200	
ベルーナ	44,700	697.00	31,155,900	
いよぎんホールディングス	202,400	827.80	167,546,720	
しずおかフィナンシャルグループ	377,900	1,054.50	398,495,550	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	143,200	876.20	125,471,840	
楽天銀行	59,200	1,890.00	111,888,000	
島根銀行	4,600	488.00	2,244,800	
じもとホールディングス	11,700	396.00	4,633,200	
めぶきフィナンシャルグループ	844,100	346.30	292,311,830	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,800	3,315.00	72,267,000	
九州フィナンシャルグループ	299,300	645.80	193,287,940	
ゆうちょ銀行	467,300	1,131.00	528,516,300	
富山第一銀行	54,000	763.00	41,202,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	912,700	587.60	536,302,520	
西日本フィナンシャルホールディングス	105,600	1,403.00	148,156,800	
三十三フィナンシャルグループ	15,200	1,628.00	24,745,600	
第四北越フィナンシャルグループ	26,700	3,205.00	85,573,500	
ひろぎんホールディングス	221,900	849.50	188,504,050	
おきなわフィナンシャルグループ	15,600	2,182.00	34,039,200	
十六フィナンシャルグループ	22,000	3,170.00	69,740,000	
北國フィナンシャルホールディングス	17,900	4,350.00	77,865,000	
プロクレアホールディングス	20,800	2,070.00	43,056,000	
あいちフィナンシャルグループ	23,800	2,229.00	53,050,200	
あおぞら銀行	107,000	2,709.00	289,863,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	10,653,100	1,058.00	11,270,979,800	
りそなホールディングス	2,149,900	727.00	1,562,977,300	
三井住友トラスト・ホールディングス	309,100	5,326.00	1,646,266,600	
三井住友フィナンシャルグループ	1,243,000	6,128.00	7,617,104,000	
千葉銀行	474,100	918.60	435,508,260	
群馬銀行	330,100	548.50	181,059,850	
武蔵野銀行	21,800	2,340.00	51,012,000	
千葉興業銀行	30,900	656.00	20,270,400	
筑波銀行	74,600	210.00	15,666,000	
七十七銀行	54,500	2,719.00	148,185,500	
秋田銀行	11,400	1,699.00	19,368,600	
山形銀行	18,900	1,065.00	20,128,500	
岩手銀行	11,600	2,129.00	24,696,400	
東邦銀行	134,500	233.00	31,338,500	
東北銀行	6,400	1,036.00	6,630,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	135,800	3,131.00	425,189,800	
スルガ銀行	149,900	575.00	86,192,500	
八十二銀行	359,300	656.80	235,988,240	

山梨中央銀行	17,500	1,312.00	22,960,000	
大垣共立銀行	32,400	1,867.00	60,490,800	
福井銀行	15,200	1,460.00	22,192,000	
清水銀行	6,800	1,468.00	9,982,400	
富山銀行	2,000	1,692.00	3,384,000	
滋賀銀行	28,300	2,815.00	79,664,500	
南都銀行	25,600	2,460.00	62,976,000	
百五銀行	160,000	442.00	70,720,000	
京都銀行	53,900	7,379.00	397,728,100	
紀陽銀行	60,900	1,467.00	89,340,300	
ほくほくフィナンシャルグループ	108,100	1,210.50	130,855,050	
山陰合同銀行	106,500	855.00	91,057,500	
鳥取銀行	4,200	1,175.00	4,935,000	
百十四銀行	15,500	1,929.00	29,899,500	
四国銀行	27,000	884.00	23,868,000	
阿波銀行	23,900	2,014.00	48,134,600	
大分銀行	10,200	2,253.00	22,980,600	
宮崎銀行	11,100	2,427.00	26,939,700	
佐賀銀行	10,000	1,720.00	17,200,000	
琉球銀行	39,000	976.00	38,064,000	
セブン銀行	609,300	289.60	176,453,280	
みずほフィナンシャルグループ	2,460,100	2,224.50	5,472,492,450	
高知銀行	4,500	755.00	3,397,500	
山口フィナンシャルグループ	187,800	1,034.00	194,185,200	
名古屋銀行	11,200	3,490.00	39,088,000	
北洋銀行	257,700	290.00	74,733,000	
大光銀行	3,900	1,088.00	4,243,200	
愛媛銀行	22,900	827.00	18,938,300	
トマト銀行	4,400	1,048.00	4,611,200	
京葉銀行	77,900	556.00	43,312,400	
栃木銀行	77,900	263.00	20,487,700	
北日本銀行	6,000	2,060.00	12,360,000	
東和銀行	31,200	547.00	17,066,400	
福島銀行	13,900	217.00	3,016,300	
大東銀行	5,200	652.00	3,390,400	
トモニホールディングス	137,500	376.00	51,700,000	
フィデアホールディングス	17,600	1,413.00	24,868,800	
池田泉州ホールディングス	217,800	246.00	53,578,800	
ＦＰＧ	57,700	1,283.00	74,029,100	
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,100	1,170.00	16,497,000	
マーキュリアホールディングス	8,000	792.00	6,336,000	
ＳＢＩホールディングス	246,300	2,821.00	694,812,300	

ジャフコ　グループ	56,900	1,799.50	102,391,550	
大和証券グループ本社	1,216,600	717.50	872,910,500	
野村ホールディングス	3,133,100	541.40	1,696,260,340	
岡三証券グループ	149,700	482.00	72,155,400	
丸三証券	57,000	438.00	24,966,000	
東洋証券	57,000	300.00	17,100,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	185,600	392.00	72,755,200	
光世証券	3,300	567.00	1,871,100	
水戸証券	46,200	340.00	15,708,000	
いちよし証券	31,600	609.00	19,244,400	
松井証券	100,700	797.00	80,257,900	
マネックスグループ	183,600	540.00	99,144,000	
極東証券	21,500	649.00	13,953,500	
岩井コスモホールディングス	19,500	1,472.00	28,704,000	
アイザワ証券グループ	24,800	803.00	19,914,400	
マネーパートナーズグループ	14,500	267.00	3,871,500	
スパークス・グループ	19,100	1,488.00	28,420,800	
かんぽ生命保険	198,000	2,236.50	442,827,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	291,900	6,571.00	1,918,074,900	
アニコム　ホールディングス	57,800	637.00	36,818,600	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	346,200	5,220.00	1,807,164,000	
第一生命ホールディングス	831,000	2,867.50	2,382,892,500	
東京海上ホールディングス	1,681,400	3,279.00	5,513,310,600	
Ｔ＆Ｄホールディングス	456,500	2,221.50	1,014,114,750	
アドバンスクリエイト	9,800	1,224.00	11,995,200	
全国保証	44,600	4,946.00	220,591,600	
あんしん保証	7,800	307.00	2,394,600	
イントラスト	5,500	937.00	5,153,500	
日本モーゲージサービス	8,000	570.00	4,560,000	
Ｃａｓａ	5,500	933.00	5,131,500	
アルヒ	21,400	984.00	21,057,600	
プレミアグループ	28,900	1,721.00	49,736,900	
ネットプロテクションズホールディングス	57,500	333.00	19,147,500	
クレディセゾン	108,000	2,242.50	242,190,000	
芙蓉総合リース	15,700	11,020.00	173,014,000	
みずほリース	25,400	4,650.00	118,110,000	
東京センチュリー	31,900	5,122.00	163,391,800	
日本証券金融	62,900	1,090.00	68,561,000	
アイフル	282,900	335.00	94,771,500	
リコーリース	16,200	4,245.00	68,769,000	
イオンフィナンシャルサービス	98,000	1,278.00	125,244,000	
アコム	304,700	350.90	106,919,230	

ジャックス	18,200	5,070.00	92,274,000	
オリエントコーポレーション	44,800	1,146.00	51,340,800	
オリックス	1,116,700	2,538.50	2,834,742,950	
三菱ＨＣキャピタル	663,700	865.50	574,432,350	
九州リースサービス	6,600	881.00	5,814,600	
日本取引所グループ	478,100	2,339.50	1,118,514,950	
イー・ギャランティ	27,800	1,900.00	52,820,000	
アサックス	6,600	645.00	4,257,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	8,500	3,125.00	26,562,500	
大東建託	62,400	14,225.00	887,640,000	
いちご	198,300	287.00	56,912,100	
日本駐車場開発	183,100	225.00	41,197,500	
スター・マイカ・ホールディングス	16,500	618.00	10,197,000	
ＳＲＥホールディングス	8,500	3,585.00	30,472,500	
ＡＤワークスグループ	33,300	202.00	6,726,600	
ヒューリック	397,400	1,212.50	481,847,500	
三栄建築設計	8,700	1,444.00	12,562,800	
野村不動産ホールディングス	106,600	3,478.00	370,754,800	
三重交通グループホールディングス	37,700	552.00	20,810,400	
サムティ	27,400	2,254.00	61,759,600	
ディア・ライフ	29,800	829.00	24,704,200	
地主	13,400	1,863.00	24,964,200	
プレサンスコーポレーション	27,200	2,004.00	54,508,800	
ハウスコム	2,900	924.00	2,679,600	
ＪＰＭＣ	9,200	1,093.00	10,055,600	
サンセイランディック	4,600	968.00	4,452,800	
フージャースホールディングス	26,200	994.00	26,042,800	
オープンハウスグループ	62,400	4,967.00	309,940,800	
東急不動産ホールディングス	512,300	820.50	420,342,150	
飯田グループホールディングス	149,300	2,430.00	362,799,000	
イーグランド	2,500	1,528.00	3,820,000	
ムゲンエステート	9,800	705.00	6,909,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	10,100	1,093.00	11,039,300	
シーアールイー	10,000	1,369.00	13,690,000	
ケイアイスター不動産	8,300	4,775.00	39,632,500	
グッドコムアセット	16,600	822.00	13,645,200	
ジェイ・エス・ビー	4,300	4,965.00	21,349,500	
ロードスターキャピタル	10,100	1,611.00	16,271,100	
テンポイノベーション	4,600	1,167.00	5,368,200	
フェイスネットワーク	4,100	1,515.00	6,211,500	
パーク２４	133,000	1,827.50	243,057,500	
パラカ	6,400	1,938.00	12,403,200	

三井不動産	726,100	2,789.00	2,025,092,900	
三菱地所	1,026,800	1,711.00	1,756,854,800	
平和不動産	27,800	3,785.00	105,223,000	
東京建物	162,500	1,875.00	304,687,500	
京阪神ビルディング	29,200	1,148.00	33,521,600	
住友不動産	307,700	3,570.00	1,098,489,000	
テーオーシー	31,900	617.00	19,682,300	
東京楽天地	3,000	4,145.00	12,435,000	
レオパレス２１	191,500	299.00	57,258,500	
スターツコーポレーション	24,700	2,845.00	70,271,500	
フジ住宅	24,800	678.00	16,814,400	
空港施設	21,800	556.00	12,120,800	
明和地所	7,000	1,051.00	7,357,000	
ゴールドクレスト	16,600	1,850.00	30,710,000	
エスリード	8,300	2,633.00	21,853,900	
日神グループホールディングス	28,700	502.00	14,407,400	
日本エスコン	38,200	805.00	30,751,000	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	86,000	456.00	39,216,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	8,200	883.00	7,240,600	
イオンモール	88,600	1,861.00	164,884,600	
毎日コムネット	5,800	744.00	4,315,200	
ファースト住建	6,000	1,105.00	6,630,000	
カチタス	46,000	2,575.00	118,450,000	
トーセイ	28,700	1,803.00	51,746,100	
穴吹興産	2,900	2,181.00	6,324,900	
サンフロンティア不動産	28,800	1,412.00	40,665,600	
ＦＪネクストホールディングス	18,600	1,022.00	19,009,200	
インテリックス	3,200	521.00	1,667,200	
ランドビジネス	4,800	263.00	1,262,400	
サンネクスタグループ	4,600	975.00	4,485,000	
グランディハウス	12,300	581.00	7,146,300	
日本空港ビルデング	60,300	6,362.00	383,628,600	
明豊ファシリティワークス	7,300	765.00	5,584,500	
ＬＩＦＵＬＬ	61,800	293.00	18,107,400	
ＭＩＸＩ	40,500	2,629.00	106,474,500	
ジェイエイシーリクルートメント	16,200	2,592.00	41,990,400	
日本M&Aセンターホールディングス	305,000	1,049.00	319,945,000	
メンバーズ	5,400	1,655.00	8,937,000	
中広	2,700	412.00	1,112,400	
ＵＴグループ	26,200	2,854.00	74,774,800	
アイティメディア	7,000	1,308.00	9,156,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	10,600	1,574.00	16,684,400	

オープンアップグループ	53,400	2,013.00	107,494,200	
コシダカホールディングス	53,400	1,152.00	61,516,800	
アルトナー	3,500	1,862.00	6,517,000	
パソナグループ	21,700	1,665.00	36,130,500	
ＣＤＳ	3,600	1,764.00	6,350,400	
リンクアンドモチベーション	51,100	420.00	21,462,000	
エス・エム・エス	67,700	2,787.50	188,713,750	
サニーサイドアップグループ	4,500	716.00	3,222,000	
パーソルホールディングス	195,900	2,598.50	509,046,150	
リニカル	8,200	784.00	6,428,800	
クックパッド	50,500	156.00	7,878,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,300	593.00	4,328,900	
学情	8,200	1,880.00	15,416,000	
スタジオアリス	9,000	2,168.00	19,512,000	
シミックホールディングス	8,700	1,895.00	16,486,500	
エプコ	3,400	729.00	2,478,600	
ＮＪＳ	4,000	2,672.00	10,688,000	
綜合警備保障	329,900	798.90	263,557,110	
カカクコム	130,500	2,042.00	266,481,000	
アイロムグループ	6,500	1,934.00	12,571,000	
セントケア・ホールディング	11,700	766.00	8,962,200	
サイネックス	2,800	652.00	1,825,600	
ルネサンス	12,800	897.00	11,481,600	
ディップ	31,200	3,535.00	110,292,000	
デジタルホールディングス	14,200	1,055.00	14,981,000	
新日本科学	19,000	2,051.00	38,969,000	
キャリアデザインセンター	3,100	1,623.00	5,031,300	
ベネフィット・ワン	82,500	1,397.00	115,252,500	
エムスリー	350,900	3,028.00	1,062,525,200	
ツカダ・グローバルホールディング	8,900	452.00	4,022,800	
アウトソーシング	106,000	1,356.50	143,789,000	
ウェルネット	11,100	576.00	6,393,600	
ワールドホールディングス	8,100	2,617.00	21,197,700	
ディー・エヌ・エー	71,200	1,826.50	130,046,800	
博報堂ＤＹホールディングス	226,700	1,442.50	327,014,750	
ぐるなび	33,600	356.00	11,961,600	
タカミヤ	24,700	537.00	13,263,900	
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	727.00	6,397,600	
ファンコミュニケーションズ	35,600	404.00	14,382,400	
ライク	6,800	1,679.00	11,417,200	
ビジネス・ブレークスルー	5,900	444.00	2,619,600	
エスプール	51,500	620.00	31,930,000	

ＷＤＢホールディングス	9,200	2,046.00	18,823,200	
ティア	8,900	452.00	4,022,800	
ＣＤＧ	1,700	1,380.00	2,346,000	
アドウェイズ	24,900	655.00	16,309,500	
バリューコマース	13,600	1,326.00	18,033,600	
インフォマート	185,300	334.00	61,890,200	
ＪＰホールディングス	52,100	320.00	16,672,000	
エコナックホールディングス	27,300	95.00	2,593,500	
ＣＬホールディングス	5,300	810.00	4,293,000	
プレステージ・インターナショナル	75,300	593.00	44,652,900	
アミューズ	9,800	1,785.00	17,493,000	
ドリームインキュベータ	5,500	2,735.00	15,042,500	
クイック	13,700	2,234.00	30,605,800	
ＴＡＣ	8,300	201.00	1,668,300	
電通グループ	174,600	4,616.00	805,953,600	
イオンファンタジー	7,800	3,115.00	24,297,000	
シーティーエス	20,100	743.00	14,934,300	
ネクシィーズグループ	4,800	634.00	3,043,200	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	52,100	2,678.50	139,549,850	
アルプス技研	15,600	2,779.00	43,352,400	
日本空調サービス	19,500	746.00	14,547,000	
オリエンタルランド	939,700	5,528.00	5,194,661,600	
ダスキン	39,600	3,203.00	126,838,800	
明光ネットワークジャパン	22,100	647.00	14,298,700	
ファルコホールディングス	8,200	1,862.00	15,268,400	
ラウンドワン	149,000	580.00	86,420,000	
リゾートトラスト	70,200	2,175.00	152,685,000	
ビー・エム・エル	22,000	2,771.00	60,962,000	
リソー教育	81,900	272.00	22,276,800	
早稲田アカデミー	10,100	1,322.00	13,352,200	
ユー・エス・エス	182,700	2,375.50	434,003,850	
東京個別指導学院	21,700	503.00	10,915,100	
サイバーエージェント	392,600	1,042.00	409,089,200	
楽天グループ	1,066,800	538.30	574,258,440	
クリーク・アンド・リバー社	10,600	1,965.00	20,829,000	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	29,600	514.00	15,214,400	
テー・オー・ダブリュー	35,800	308.00	11,026,400	
山田コンサルティンググループ	9,200	1,572.00	14,462,400	
セントラルスポーツ	6,800	2,354.00	16,007,200	
フルキャストホールディングス	17,100	2,282.00	39,022,200	
エン・ジャパン	32,200	2,419.00	77,891,800	
リソルホールディングス	1,300	4,750.00	6,175,000	

テクノプロ・ホールディングス	105,100	3,051.00	320,660,100	
アトラグループ	3,100	179.00	554,900	
インターワークス	4,500	334.00	1,503,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,400	1,697.00	15,951,800	
ＫｅｅＰｅｒ技研	11,000	5,570.00	61,270,000	
ファーストロジック	1,900	990.00	1,881,000	
三機サービス	2,300	1,149.00	2,642,700	
Ｇｕｎｏｓｙ	14,600	608.00	8,876,800	
デザインワン・ジャパン	5,300	182.00	964,600	
イー・ガーディアン	6,900	2,094.00	14,448,600	
リブセンス	7,500	288.00	2,160,000	
ジャパンマテリアル	54,500	2,280.00	124,260,000	
ベクトル	28,100	1,306.00	36,698,600	
ウチヤマホールディングス	6,800	344.00	2,339,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	15,000	1,288.00	19,320,000	
キャリアリンク	6,600	2,886.00	19,047,600	
ＩＢＪ	11,300	648.00	7,322,400	
アサンテ	9,000	1,692.00	15,228,000	
バリューＨＲ	15,800	1,286.00	20,318,800	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	14,500	3,120.00	45,240,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,032.00	6,811,200	
ＥＲＩホールディングス	3,800	1,341.00	5,095,800	
アビスト	2,300	3,275.00	7,532,500	
シグマクシス・ホールディングス	27,200	1,301.00	35,387,200	
ウィルグループ	15,100	1,092.00	16,489,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,600	144.00	2,390,400	
メドピア	15,900	978.00	15,550,200	
レアジョブ	3,000	993.00	2,979,000	
リクルートホールディングス	1,314,500	4,487.00	5,898,161,500	
エラン	23,900	846.00	20,219,400	
土木管理総合試験所	6,800	336.00	2,284,800	
日本郵政	2,136,600	1,039.00	2,219,927,400	
ベルシステム２４ホールディングス	24,000	1,358.00	32,592,000	
鎌倉新書	20,600	709.00	14,605,400	
ＳＭＮ	4,000	448.00	1,792,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,000	686.00	2,058,000	
エアトリ	13,000	2,677.00	34,801,000	
アトラエ	10,900	742.00	8,087,800	
ストライク	7,600	3,345.00	25,422,000	
ソラスト	49,400	659.00	32,554,600	
セラク	5,600	1,559.00	8,730,400	
インソース	38,800	1,146.00	44,464,800	

ベイカレント・コンサルティング	140,600	5,193.00	730,135,800	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	4,100	1,173.00	4,809,300	
アイモバイル	8,100	1,305.00	10,570,500	
キャリアインデックス	5,800	312.00	1,809,600	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,800	1,139.00	5,467,200	
船場	2,800	752.00	2,105,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	63,500	1,849.00	117,411,500	
フルテック	2,200	1,113.00	2,448,600	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	5,100	356.00	1,815,600	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,100	585.00	1,228,500	
ウェルビー	13,700	461.00	6,315,700	
エル・ティー・エス	2,400	3,730.00	8,952,000	
ミダックホールディングス	11,000	1,735.00	19,085,000	
日総工産	13,700	875.00	11,987,500	
キュービーネットホールディングス	8,600	1,513.00	13,011,800	
ＲＰＡホールディングス	24,800	405.00	10,044,000	
スプリックス	4,400	793.00	3,489,200	
マネジメントソリューションズ	9,900	3,965.00	39,253,500	
プロレド・パートナーズ	5,000	500.00	2,500,000	
テノ．ホールディングス	2,200	680.00	1,496,000	
フロンティア・マネジメント	6,200	1,363.00	8,450,600	
ピアラ	2,900	488.00	1,415,200	
コプロ・ホールディングス	2,400	2,032.00	4,876,800	
ギークス	2,300	737.00	1,695,100	
アンビスホールディングス	19,100	2,884.00	55,084,400	
カーブスホールディングス	48,900	722.00	35,305,800	
フォーラムエンジニアリング	10,600	1,178.00	12,486,800	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	6,300	1,307.00	8,234,100	
ダイレクトマーケティングミックス	21,600	874.00	18,878,400	
ポピンズ	2,900	1,425.00	4,132,500	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	14,000	2,228.00	31,192,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,800	590.00	4,012,000	
リログループ	99,000	1,909.00	188,991,000	
東祥	12,600	1,275.00	16,065,000	
ＩＤ&Ｅホールディングス	10,800	3,140.00	33,912,000	
ビーウィズ	4,600	2,260.00	10,396,000	
ＴＲＥホールディングス	37,600	1,245.00	46,812,000	
人・夢・技術グループ	6,900	1,673.00	11,543,700	
大栄環境	45,300	2,374.00	107,542,200	
日本管財ホールディングス	18,700	2,587.00	48,376,900	
エイチ・アイ・エス	46,600	1,990.00	92,734,000	
ラックランド	7,500	3,085.00	23,137,500	

共立メンテナンス	30,500	5,434.00	165,737,000	
イチネンホールディングス	19,000	1,337.00	25,403,000	
建設技術研究所	9,200	3,355.00	30,866,000	
スペース	13,200	1,045.00	13,794,000	
燦ホールディングス	7,700	2,145.00	16,516,500	
スバル興業	900	9,930.00	8,937,000	
東京テアトル	5,100	1,123.00	5,727,300	
タナベコンサルティンググループ	5,700	1,009.00	5,751,300	
ナガワ	4,800	6,810.00	32,688,000	
東京都競馬	14,900	3,810.00	56,769,000	
カナモト	32,700	2,337.00	76,419,900	
ニシオホールディングス	16,600	3,440.00	57,104,000	
トランス・コスモス	22,200	3,370.00	74,814,000	
乃村工藝社	77,800	949.00	73,832,200	
藤田観光	7,900	3,360.00	26,544,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	10,600	1,446.00	15,327,600	
トーカイ	15,900	1,879.00	29,876,100	
セコム	180,900	9,402.00	1,700,821,800	
セントラル警備保障	9,700	2,898.00	28,110,600	
丹青社	34,800	784.00	27,283,200	
メイテック	69,400	2,408.50	167,149,900	
応用地質	16,700	2,252.00	37,608,400	
船井総研ホールディングス	37,100	2,456.00	91,117,600	
進学会ホールディングス	5,600	292.00	1,635,200	
オオバ	9,000	760.00	6,840,000	
いであ	3,200	1,703.00	5,449,600	
学究社	7,200	2,063.00	14,853,600	
ベネッセホールディングス	66,400	1,826.00	121,246,400	
イオンディライト	19,700	3,025.00	59,592,500	
ナック	8,200	960.00	7,872,000	
ダイセキ	36,300	4,245.00	154,093,500	
ステップ	6,600	1,757.00	11,596,200	
合　計	255,618,500		553,511,905,010	

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
新株予約権証券	テスホールディングス株式会社第３回新株予約権	18,700	5,236,000	
合計		18,700	5,236,000	

(注)券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	658,301,284
株式	10,919,758,700
投資証券	142,269,700
未収配当金	14,012,603
前払金	983,750
差入委託証拠金	2,626,500
流動資産合計	11,737,952,537
資産合計	11,737,952,537
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	986,060
未払金	140,778
未払解約金	604,876,319
未払利息	548
流動負債合計	606,003,705
負債合計	606,003,705
純資産の部	
元本等	
元本	9,069,684,311
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,062,264,521
元本等合計	11,131,948,832
純資産合計	11,131,948,832
負債純資産合計	11,737,952,537

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10日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	2023年 7月10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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	9,069,684,311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 1.2274円 (1万口当たり純資産額) (12,274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 7月10日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	533,705,648円
期中追加設定元本額	9,836,119,363円
期中一部解約元本額	1,300,140,700円
期末元本額	9,069,684,311円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	206,252,795円
コア投資戦略ファンド（成長型）	465,879,556円
コア投資戦略ファンド（切替型）	240,510,570円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	6,837,088,680円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	105,416,524円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	177,935,243円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	37,500,556円
ＤＣ日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスファンド	871,562,593円
私募日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	39,910,153円
ＦＯＦｓ用　日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	87,627,641円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,241,544,749
投資証券	3,228,200
合計	1,244,772,949

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド」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 7月10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	68,138,750	－	67,155,000	△983,750
合計		68,138,750	－	67,155,000	△983,750

(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)	
ＩＮＰＥＸ	33,100	1,616.50	53,506,150	
大林組	22,100	1,230.00	27,183,000	
清水建設	18,800	897.60	16,874,880	
大和ハウス工業	20,500	3,690.00	75,645,000	
積水ハウス	21,000	2,861.50	60,091,500	
高砂熱学工業	1,400	2,441.00	3,417,400	
大氣社	800	4,005.00	3,204,000	
明治ホールディングス	7,500	3,264.00	24,480,000	
サッポロホールディングス	2,100	3,609.00	7,578,900	
アサヒグループホールディングス	16,400	5,452.00	89,412,800	
キリンホールディングス	26,500	2,075.00	54,987,500	
サントリー食品インターナショナル	4,700	5,068.00	23,819,600	
伊藤園	1,500	3,859.00	5,788,500	
キッコーマン	4,600	7,886.00	36,275,600	
味の素	15,400	5,615.00	86,471,000	
キユーピー	3,400	2,462.50	8,372,500	
カゴメ	2,600	3,126.00	8,127,600	

ニチレイ	3,700	3,046.00	11,270,200	
日清食品ホールディングス	2,100	11,905.00	25,000,500	
東洋紡	2,700	1,111.00	2,999,700	
帝人	6,100	1,476.50	9,006,650	
東レ	47,300	796.90	37,693,370	
クラレ	9,700	1,384.00	13,424,800	
旭化成	42,800	973.90	41,682,920	
住友化学	48,000	437.80	21,014,400	
東ソー	8,900	1,728.00	15,379,200	
デンカ	2,600	2,734.00	7,108,400	
カネカ	1,600	4,053.00	6,484,800	
三井化学	5,800	4,152.00	24,081,600	
ＪＳＲ	6,000	4,095.00	24,570,000	
東京応化工業	1,100	8,700.00	9,570,000	
三菱ケミカルグループ	43,700	849.40	37,118,780	
ダイセル	8,800	1,296.00	11,404,800	
積水化学工業	12,500	2,018.00	25,225,000	
ＵＢＥ	3,100	2,493.50	7,729,850	
花王	15,900	5,371.00	85,398,900	
日本ペイントホールディングス	32,300	1,160.00	37,468,000	
関西ペイント	5,600	2,078.50	11,639,600	
ＤＩＣ	2,600	2,633.00	6,845,800	
富士フイルムホールディングス	12,700	8,271.00	105,041,700	
日東電工	5,100	10,070.00	51,357,000	
信越ポリマー	1,400	1,455.00	2,037,000	
ニフコ	2,700	4,042.00	10,913,400	
ユニ・チャーム	13,800	5,334.00	73,609,200	
協和キリン	9,200	2,601.50	23,933,800	
アステラス製薬	61,700	2,038.00	125,744,600	
塩野義製薬	8,900	5,788.00	51,513,200	
エーザイ	8,600	9,247.00	79,524,200	
小野薬品工業	13,200	2,517.00	33,224,400	
第一三共	63,100	4,005.00	252,715,500	
ＥＮＥＯＳホールディングス	98,300	495.00	48,658,500	
ブリヂストン	19,500	5,730.00	111,735,000	
住友理工	1,200	831.00	997,200	
太平洋セメント	4,000	2,763.00	11,052,000	
ＴＯＴＯ	4,500	4,198.00	18,891,000	
日本特殊陶業	5,200	2,909.50	15,129,400	
日本製鉄	27,500	2,972.00	81,730,000	
神戸製鋼所	12,200	1,373.00	16,750,600	
ＪＦＥホールディングス	16,800	1,992.50	33,474,000	

日本軽金属ホールディングス	1,900	1,457.00	2,768,300	
三井金属鉱業	1,900	3,238.00	6,152,200	
三菱マテリアル	4,300	2,496.00	10,732,800	
住友金属鉱山	8,400	4,581.00	38,480,400	
ＤＯＷＡホールディングス	1,800	4,530.00	8,154,000	
ＵＡＣＪ	1,200	2,707.00	3,248,400	
ＬＩＸＩＬ	9,800	1,816.00	17,796,800	
三浦工業	3,000	3,604.00	10,812,000	
アマダ	11,600	1,392.00	16,147,200	
ナブテスコ	3,700	3,107.00	11,495,900	
小松製作所	31,500	3,714.00	116,991,000	
日立建機	3,700	3,887.00	14,381,900	
クボタ	34,500	2,024.00	69,828,000	
荏原製作所	3,100	6,823.00	21,151,300	
ダイキン工業	9,000	28,745.00	258,705,000	
栗田工業	3,600	5,392.00	19,411,200	
ダイフク	10,400	2,934.50	30,518,800	
グローリー	1,400	2,790.00	3,906,000	
セガサミーホールディングス	5,300	2,985.50	15,823,150	
ＮＴＮ	13,600	302.80	4,118,080	
日立造船	5,500	919.00	5,054,500	
三菱重工業	10,900	6,529.00	71,166,100	
イビデン	3,800	8,073.00	30,677,400	
コニカミノルタ	15,400	497.40	7,659,960	
ブラザー工業	7,900	2,074.50	16,388,550	
日立製作所	32,000	8,842.00	282,944,000	
富士電機	4,300	5,945.00	25,563,500	
安川電機	8,200	6,003.00	49,224,600	
オムロン	6,000	8,562.00	51,372,000	
日本電気	8,400	6,848.00	57,523,200	
富士通	6,000	18,010.00	108,060,000	
ルネサスエレクトロニクス	43,400	2,624.50	113,903,300	
セイコーエプソン	9,800	2,191.00	21,471,800	
アルバック	1,600	5,837.00	9,339,200	
パナソニック　ホールディングス	75,300	1,688.50	127,144,050	
シャープ	7,800	786.40	6,133,920	
アンリツ	4,600	1,239.00	5,699,400	
ソニーグループ	43,000	12,830.00	551,690,000	
ＴＤＫ	13,300	5,321.00	70,769,300	
アルプスアルパイン	6,400	1,220.50	7,811,200	
横河電機	7,800	2,642.50	20,611,500	
アズビル	3,900	4,419.00	17,234,100	

アドバンテスト	6,500	19,470.00	126,555,000	
シスメックス	5,700	9,542.00	54,389,400	
スタンレー電気	4,400	2,669.50	11,745,800	
ファナック	32,700	4,747.00	155,226,900	
太陽誘電	4,000	4,143.00	16,572,000	
村田製作所	19,600	7,954.00	155,898,400	
リコー	18,700	1,218.50	22,785,950	
東京エレクトロン	15,300	19,900.00	304,470,000	
川崎重工業	5,200	3,670.00	19,084,000	
トヨタ自動車	361,700	2,260.00	817,442,000	
ヤマハ発動機	10,200	4,033.00	41,136,600	
島津製作所	8,100	4,375.00	35,437,500	
ニコン	10,200	1,810.00	18,462,000	
ＨＯＹＡ	12,200	16,025.00	195,505,000	
前田工繊	600	3,020.00	1,812,000	
大日本印刷	7,500	3,965.00	29,737,500	
ＮＩＳＳＨＡ	1,300	1,702.00	2,212,600	
アシックス	5,500	4,248.00	23,364,000	
ヤマハ	4,800	5,253.00	25,214,400	
リンテック	1,300	2,305.00	2,996,500	
任天堂	35,400	6,305.00	223,197,000	
コクヨ	2,900	2,010.00	5,829,000	
美津濃	600	3,695.00	2,217,000	
東北電力	15,400	883.50	13,605,900	
九州電力	13,700	906.60	12,420,420	
電源開発	5,000	2,159.50	10,797,500	
レノバ	1,300	1,505.00	1,956,500	
東京瓦斯	13,300	3,112.00	41,389,600	
大阪瓦斯	12,800	2,132.00	27,289,600	
東邦瓦斯	2,500	2,437.50	6,093,750	
西部ガスホールディングス	800	2,023.00	1,618,400	
東武鉄道	6,400	3,649.00	23,353,600	
相鉄ホールディングス	2,700	2,488.50	6,718,950	
東急	18,100	1,692.00	30,625,200	
京王電鉄	3,500	4,283.00	14,990,500	
西日本旅客鉄道	7,500	5,826.00	43,695,000	
西武ホールディングス	7,700	1,491.50	11,484,550	
西日本鉄道	2,000	2,449.00	4,898,000	
阪急阪神ホールディングス	7,800	4,584.00	35,755,200	
南海電気鉄道	3,500	3,063.00	10,720,500	
京阪ホールディングス	3,500	3,676.00	12,866,000	
名古屋鉄道	6,400	2,246.00	14,374,400	

ヤマトホールディングス	9,700	2,598.50	25,205,450	
山九	1,700	4,776.00	8,119,200	
センコーグループホールディングス	3,700	1,017.00	3,762,900	
九州旅客鉄道	4,600	3,085.00	14,191,000	
ＳＧホールディングス	10,900	2,070.50	22,568,450	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	2,500	8,069.00	20,172,500	
日本郵船	16,500	3,260.00	53,790,000	
ＡＮＡホールディングス	5,500	3,396.00	18,678,000	
トランコム	200	6,900.00	1,380,000	
ＴＩＳ	7,500	3,569.00	26,767,500	
ＳＨＩＦＴ	400	25,375.00	10,150,000	
ティーガイア	600	1,726.00	1,035,600	
オープンドア	400	1,263.00	505,200	
マネーフォワード	1,500	5,550.00	8,325,000	
ビジョナル	700	7,560.00	5,292,000	
野村総合研究所	13,200	3,841.00	50,701,200	
メルカリ	3,900	3,428.00	13,369,200	
Ｚホールディングス	91,100	369.20	33,634,120	
伊藤忠テクノソリューションズ	3,300	3,498.00	11,543,400	
ＢＩＰＲＯＧＹ	2,600	3,405.00	8,853,000	
ビジョン	1,300	1,704.00	2,215,200	
ＫＤＤＩ	51,000	4,307.00	219,657,000	
ソフトバンク	98,000	1,530.50	149,989,000	
ＮＴＴデータグループ	21,500	1,913.00	41,129,500	
カプコン	5,900	5,557.00	32,786,300	
ＳＣＳＫ	5,300	2,221.50	11,773,950	
ＴＯＫＡＩホールディングス	3,300	894.00	2,950,200	
アズワン	1,000	5,454.00	5,454,000	
伊藤忠商事	40,500	5,524.00	223,722,000	
丸紅	52,100	2,395.00	124,779,500	
三井物産	44,800	5,157.00	231,033,600	
キヤノンマーケティングジャパン	1,600	3,568.00	5,708,800	
モスフードサービス	800	3,220.00	2,576,000	
ローソン	1,500	6,294.00	9,441,000	
ゲオホールディングス	800	1,934.00	1,547,200	
アダストリア	800	2,919.00	2,335,200	
ジンズホールディングス	400	3,345.00	1,338,000	
ＤＣＭホールディングス	3,700	1,200.00	4,440,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	8,300	1,369.50	11,366,850	
マツキヨココカラ＆カンパニー	3,900	7,995.00	31,180,500	
ＺＯＺＯ	4,300	2,853.00	12,267,900	
オイシックス・ラ・大地	1,000	2,382.00	2,382,000	

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,800	1,116.00	2,008,800	
イオン北海道	1,400	881.00	1,233,400	
スギホールディングス	1,100	6,289.00	6,917,900	
日本瓦斯	3,600	1,961.50	7,061,400	
マックスバリュ東海	300	2,752.00	825,600	
丸井グループ	6,000	2,452.00	14,712,000	
イオン	22,300	2,964.50	66,108,350	
平和堂	1,000	2,347.00	2,347,000	
ヤオコー	600	7,259.00	4,355,400	
ヤマダホールディングス	19,800	424.70	8,409,060	
ファーストリテイリング	6,000	34,650.00	207,900,000	
サンドラッグ	2,400	4,204.00	10,089,600	
りそなホールディングス	73,000	727.00	53,071,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	11,300	5,326.00	60,183,800	
三井住友フィナンシャルグループ	44,500	6,128.00	272,696,000	
みずほフィナンシャルグループ	82,300	2,224.50	183,076,350	
大和証券グループ本社	45,500	717.50	32,646,250	
野村ホールディングス	99,300	541.40	53,761,020	
ＳＯＭＰＯホールディングス	10,700	6,571.00	70,309,700	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	14,600	5,220.00	76,212,000	
東京海上ホールディングス	61,500	3,279.00	201,658,500	
Ｔ＆Ｄホールディングス	17,100	2,221.50	37,987,650	
東京センチュリー	1,300	5,122.00	6,658,600	
オリックス	40,000	2,538.50	101,540,000	
ヒューリック	13,100	1,212.50	15,883,750	
野村不動産ホールディングス	3,700	3,478.00	12,868,600	
三井不動産	30,700	2,789.00	85,622,300	
三菱地所	38,400	1,711.00	65,702,400	
平和不動産	1,000	3,785.00	3,785,000	
東京建物	6,400	1,875.00	12,000,000	
住友不動産	9,700	3,570.00	34,629,000	
ディップ	1,200	3,535.00	4,242,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	1,900	2,678.50	5,089,150	
オリエンタルランド	37,200	5,528.00	205,641,600	
ダスキン	1,400	3,203.00	4,484,200	
リゾートトラスト	2,600	2,175.00	5,655,000	
サイバーエージェント	14,700	1,042.00	15,317,400	
楽天グループ	50,900	538.30	27,399,470	
テクノプロ・ホールディングス	3,700	3,051.00	11,288,700	
リクルートホールディングス	49,200	4,487.00	220,760,400	
エラン	1,000	846.00	846,000	

インソース	1,700	1,146.00	1,948,200	
カーブスホールディングス	1,800	722.00	1,299,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	700	2,228.00	1,559,600	
乃村工藝社	2,700	949.00	2,562,300	
セコム	7,200	9,402.00	67,694,400	
ベネッセホールディングス	2,300	1,826.00	4,199,800	
合　計	3,485,100		10,919,758,700	

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	森ヒルズリート投資法人	52	7,690,800	
	日本プロロジスリート投資法人	75	21,645,000	
	ヒューリックリート投資法人	44	7,057,600	
	積水ハウス・リート投資法人	142	11,757,600	
	日本ビルファンド投資法人	52	30,472,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	44	24,376,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	29	10,280,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	100	14,550,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	30	9,225,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	41	5,215,200	
合計		609	142,269,700	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本債券ツイン戦略マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,507,882,051
国債証券	27,599,437,400
社債券	35,835,062,000
プット・オプション（買）	15,250,000

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	15,614,390
未収入金	3,708,063,340
未収利息	93,964,914
前払費用	6,740,893
差入委託証拠金	65,800,000
流動資産合計	69,847,814,988
資産合計	69,847,814,988
負債の部	
流動負債	
コール・オプション（売）	3,125,000
前受金	15,620,000
未払金	4,690,127,000
未払解約金	140,836
未払利息	2,090
流動負債合計	4,709,014,926
負債合計	4,709,014,926
純資産の部	
元本等	
元本	68,473,789,238
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△3,334,989,176
元本等合計	65,138,800,062
純資産合計	65,138,800,062
負債純資産合計	69,847,814,988

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10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。 (2)債券店頭オプション取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。

	2023年 7月10日現在
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10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	68,473,789,238口
2.	「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損　3,334,989,176円
3.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　0.9513円 (1万口当たり純資産額)　(9,513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 7月10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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引、債券店頭オプション取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。債券店頭オプション取引に係る主要なリスクは、オプション相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	73,628,336,848円
期中追加設定元本額	23,471,667,209円
期中一部解約元本額	28,626,214,819円
期末元本額	68,473,789,238円

区分	2023年 7月10日現在
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,189,195,090円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,363,298,376円
国内債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	48,590,166,787円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,115,577,580円
債券コア戦略ファンド	600,532,519円
債券コア・セレクション	2,103,265,508円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	285,719,976円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	61,139,037円
日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,969,923,276円
ＦＯＦｓ用　日本債券ツイン戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,023,706,005円
私募日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	7,171,265,084円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	330,966,100
社債券	505,803,000
合計	836,769,100

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	売建	2,523,970,000	－	2,508,350,000	15,620,000
市場取引以外の取引	債券店頭オプション取引				
	買建				
	プット	12,520,250,000	－	15,250,000	7,750,000
	売建				
	コール	12,520,250,000	－	3,125,000	△3,000,000
合計		27,564,470,000	－	2,526,725,000	20,370,000

(注)1.時価の算定方法

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

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

債券店頭オプション取引の契約額等は、行使価格ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第１５８回利付国債（５年）	5,860,000,000	5,853,143,800	
	第１２回利付国債（４０年）	550,000,000	415,860,500	
	第１３回利付国債（４０年）	200,000,000	149,830,000	
	第１４回利付国債（４０年）	600,000,000	479,232,000	
	第１５回利付国債（４０年）	150,000,000	131,799,000	
	第１６回利付国債（４０年）	50,000,000	47,929,000	
	第３６５回利付国債（１０年）	300,000,000	292,767,000	
	第３６８回利付国債（１０年）	100,000,000	97,922,000	
	第３６９回利付国債（１０年）	100,000,000	100,635,000	
	第３７０回利付国債（１０年）	1,700,000,000	1,707,888,000	
	第３７１回利付国債（１０年）	700,000,000	695,674,000	
	第３１回利付国債（３０年）	230,000,000	274,394,600	
	第３５回利付国債（３０年）	100,000,000	116,288,000	
	第４１回利付国債（３０年）	450,000,000	497,970,000	
	第４６回利付国債（３０年）	200,000,000	213,822,000	
	第４７回利付国債（３０年）	290,000,000	315,348,900	
	第５１回利付国債（３０年）	420,000,000	347,004,000	
	第５２回利付国債（３０年）	420,000,000	362,703,600	
	第５８回利付国債（３０年）	680,000,000	619,344,000	
	第６３回利付国債（３０年）	500,000,000	404,075,000	
	第６４回利付国債（３０年）	620,000,000	499,255,000	
	第６９回利付国債（３０年）	70,000,000	60,284,700	
	第７０回利付国債（３０年）	550,000,000	473,170,500	
	第７３回利付国債（３０年）	650,000,000	557,433,500	
	第７４回利付国債（３０年）	500,000,000	463,805,000	

	第７６回利付国債（３０年）	200,000,000	204,448,000	
	第７７回利付国債（３０年）	500,000,000	535,355,000	
	第７８回利付国債（３０年）	300,000,000	306,753,000	
	第７９回利付国債（３０年）	740,000,000	720,168,000	
	第１５６回利付国債（２０年）	100,000,000	96,559,000	
	第１６３回利付国債（２０年）	2,700,000,000	2,624,967,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	800,000,000	729,512,000	
	第１７１回利付国債（２０年）	360,000,000	325,792,800	
	第１７３回利付国債（２０年）	1,050,000,000	959,416,500	
	第１７５回利付国債（２０年）	1,100,000,000	1,014,541,000	
	第１７６回利付国債（２０年）	100,000,000	91,931,000	
	第１７７回利付国債（２０年）	150,000,000	135,075,000	
	第１７８回利付国債（２０年）	200,000,000	182,916,000	
	第１７９回利付国債（２０年）	100,000,000	91,219,000	
	第１８２回利付国債（２０年）	100,000,000	100,637,000	
	第１８４回利付国債（２０年）	600,000,000	601,458,000	
	第１１６６回国庫短期証券	3,700,000,000	3,701,110,000	
国債証券合計		28,790,000,000	27,599,437,400	
社債券	第６回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	1,000,000,000	997,210,000	
	第８回みずほＦＧ任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	600,000,000	597,162,000	
	第２回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約	100,000,000	100,319,000	
	第３回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約	700,000,000	699,104,000	
	第１回大和証券任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	100,000,000	98,710,000	
	第３回第一生命ＨＤ利払繰延・任意償還付永久社債（劣後）	500,000,000	481,200,000	
	第４回第一生命ＨＤ利払繰延・任意償還付永久社債（劣後）	100,000,000	92,848,000	
	第１回朝日生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	98,167,000	
	第１回大樹生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	981,610,000	
	第２回ＤＭＧ森精機利払繰延・任意償還付無担保永久社債（劣後）	200,000,000	199,860,000	
	第４回ＤＭＧ森精機利払繰延・任意償還付無担保永久社債（劣後）	300,000,000	291,306,000	
	第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付非	500,000,000	501,105,000	
	第７回クレディ・アグリコル期限前償還非上位円貨社債	200,000,000	201,276,000	
	第７回ＨＳＢＣ・ＨＤ・ピーエルシー期限前償還円貨社債	200,000,000	201,548,000	
	第２４回ルノー円貨社債	500,000,000	502,055,000	

第１回大和ハウス工業利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	399,076,000	
ソシエテ・ジェネラル　０．４７２％　２０２５／０２／２７	200,000,000	197,402,000	
ＢＮＰパリバ　０．５５７％　２０２７／０５／２０	500,000,000	485,885,000	
第１回アサヒグループＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	1,004,970,000	
第１回横浜冷凍利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	96,640,000	
第３回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	200,000,000	196,096,000	
第２回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	98,331,000	
第２回ヒューリック利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	301,818,000	
第３回ヒューリック利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	301,170,000	
第１０回Ｊ．フロント　リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	99,065,000	
第１１回日本プロロジスリート投資法人無担保投資法人債	200,000,000	181,118,000	
第１回株式会社オープンハウス無担保社債	200,000,000	199,944,000	
第１回東急不動産ホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特	200,000,000	199,492,000	
第５回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	99,543,000	
第４回株式会社マクロミル無担保社債	400,000,000	398,156,000	
第５回株式会社マクロミル無担保社債	200,000,000	199,920,000	
第１回住友化学利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	385,736,000	
第２回住友化学利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	598,362,000	
第１回積水化成品工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,906,000	
第１回武田薬品工業利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	202,200,000	
第１７回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,673,000	
第２１回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	188,812,000	
第１回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	99,308,000	
第４回楽天利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	800,000,000	699,680,000	
第１７回楽天グループ株式会社無担保社債	500,000,000	358,375,000	
第１回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	500,000,000	493,690,000	
第２回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	200,000,000	189,076,000	
第３回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	600,000,000	514,506,000	
第１回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	693,399,000	

第２回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	97,559,000	
第３回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	469,370,000	
第２回かんぽ生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	196,034,000	
第１回アイシン精機利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	298,305,000	
第１回住友生命第１回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	400,000,000	399,292,000	
第１回日本生命第５回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	600,000,000	583,452,000	
第１回明治安田生命第１回劣後ローン流動化利払繰延・期限前（劣	400,000,000	380,920,000	
第１回全共連第１回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣後	300,000,000	284,379,000	
第１回ドンキホーテＨＤ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	900,000,000	902,691,000	
第２回シークス株式会社無担保社債	100,000,000	99,224,000	
第１回丸紅利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	198,436,000	
第７回三菱商事利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	295,533,000	
第１回ニプロ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	298,935,000	
第７回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	569,226,000	
第８回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	352,024,000	
第９回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	243,879,000	
第１２回株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ期限前償還	500,000,000	500,100,000	
第４回株式会社三井住友フィナンシャルグループ期限前償還条項付	200,000,000	199,884,000	
第５回株式会社三井住友フィナンシャルグループ期限前償還条項付	300,000,000	300,075,000	
第２回東京センチュリー利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	503,555,000	
第３回東京センチュリー利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	292,770,000	
第２３回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	400,000,000	400,164,000	
第２４回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,930,000	
第２５回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	500,000,000	499,235,000	
第２６回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	400,000,000	397,988,000	
第２７回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	500,000,000	499,680,000	
第２８回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,607,000	

第６４回アイフル株式会社無担保社債	100,000,000	100,127,000	
第６６回アイフル株式会社無担保社債	100,000,000	99,917,000	
第２２回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	200,000,000	199,696,000	
第３６回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	100,000,000	99,835,000	
第１回オリックス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	298,029,000	
第２回オリックス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	94,693,000	
第１回三菱ＨＣキャピタル利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	295,866,000	
第１回東京海上日動火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,300,000,000	1,264,874,000	
第５回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,200,000,000	1,165,104,000	
第２回Ｔ＆Ｄホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特約付	100,000,000	99,703,000	
第３回Ｔ＆Ｄホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特約付	100,000,000	96,259,000	
第５回三菱地所株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	199,514,000	
第３回東京建物利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	94,413,000	
第２６回イオンモール株式会社無担保社債	400,000,000	396,296,000	
第１回株式会社東祥無担保社債	100,000,000	99,929,000	
第１６７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	228,063,000	
第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	229,323,000	
第２回西日本鉄道株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	96,734,000	
第１回商船三井利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	404,432,000	
第１回日本航空株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	699,643,000	
第１０回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	99,674,000	
第４回株式会社ヤマタネ無担保社債	300,000,000	298,851,000	
第９回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	295,563,000	
第１３回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	282,582,000	
第２０回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	99,897,000	
第２１回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	99,669,000	
第２３回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	182,778,000	
第２８回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	192,040,000	
第３１回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	178,700,000	
第３３回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,624,000	
第３４回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	173,746,000	
第３６回株式会社光通信無担保社債	400,000,000	362,080,000	
第３７回株式会社光通信無担保社債	500,000,000	437,185,000	

	第１回GMOインターネット無担保社債	200,000,000	199,652,000	
	第１回東北電力利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	203,876,000	
	第２５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,798,000	
	第３５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,715,000	
	第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	194,230,000	
	第６５回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,836,000	
	第４回ソフトバンクグループ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	193,662,000	
	第５３回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債	300,000,000	300,378,000	
社債券合計		37,000,000,000	35,835,062,000	
合計			63,434,499,400	

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 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,850,440,975
コール・ローン	428,139,473
株式	544,622,314,245
投資信託受益証券	177,859,122
投資証券	11,330,312,536
派生商品評価勘定	303,189,540
未収入金	40,874,987,516
未収配当金	503,620,866
前払金	53,413,722
差入委託証拠金	4,426,215,377
流動資産合計	606,570,493,372
資産合計	606,570,493,372
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	119,373,999
未払解約金	27,413,965,206
未払利息	356

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	27,533,339,561
負債合計	27,533,339,561
純資産の部	
元本等	
元本	115,556,915,905
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	463,480,237,906
元本等合計	579,037,153,811
純資産合計	579,037,153,811
負債純資産合計	606,570,493,372

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10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10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10日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		115,556,915,905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	5.0108円
	(1万口当たり純資産額)	(50,108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 7月10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 7月10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 7月10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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	126,863,910,081円
期中追加設定元本額	15,403,827,859円
期中一部解約元本額	26,710,822,035円
期末元本額	115,556,915,905円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,580,589,534円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,398,300円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	33,835,689,546円
世界経済インデックスファンド	12,051,078,905円
外国株式インデックス・オープン	893,066,868円
ＤＣマイセレクション２５	653,919,976円
ＤＣマイセレクション５０	3,545,706,054円
ＤＣマイセレクション７５	4,371,947,394円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	12,452,522,200円
ＤＣマイセレクションＳ２５	419,188,258円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,885,192,614円
ＤＣマイセレクションＳ７５	1,851,067,622円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	29,395,337円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	152,920,311円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	116,936,220円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	9,420,206,928円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	1,009,758,842円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,912,583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）	23,440,358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）	36,392,965円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	7,918,160円

区分	2023年 7月10日現在
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）	194,321,088円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	139,436,465円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,069,317,796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）	19,573,314円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	123,606,543円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	41,094,953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）	930,096,761円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,125,506,589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）	1,432,760,892円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,017,775,692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）	523,199,973円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,419,787円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	128,402,173円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	125,596,947円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	6,280,734,070円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	242,046,382円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	970,758,714円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	164,796,239円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	5,131,452円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	871,889,346円
グローバル経済コア	537,748,511円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	15,411,138円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	6,330,186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	145,512,080円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	133,747,924円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	54,107,652円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	56,218,813円
１０資産分散投資ファンド	53,452,126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）	84,351,896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）	23,546,995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）	446,293,883円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,419,108,764円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	107,329,331円

区分	2023年 7月10日現在
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）	67,905,113円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	83,030,523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）	75,921,911円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	214,968,295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）	209,262,076円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	207,193,300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）	85,708,275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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	14,257,594,045
投資信託受益証券	△7,282,070
投資証券	436,844,688
合計	14,687,156,663

(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 7月10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	22,728,573,882	－	22,675,160,160	△53,413,722
合計		22,728,573,882	－	22,675,160,160	△53,413,722

(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10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	27,126,589,600	－	26,889,360,337	237,229,263
	アメリカドル	19,991,017,800	－	19,777,234,097	213,783,703
	カナダドル	969,525,000	－	965,566,800	3,958,200
	ユーロ	2,665,753,000	－	2,656,819,500	8,933,500
	イギリスポンド	1,210,261,800	－	1,206,433,140	3,828,660
	スイスフラン	803,455,000	－	801,206,500	2,248,500
	スウェーデンクローナ	210,528,000	－	210,699,200	△171,200
	デンマーククローネ	273,624,000	－	272,715,300	908,700
	オーストラリアドル	763,056,000	－	761,989,600	1,066,400
	香港ドル	239,369,000	－	236,696,200	2,672,800
合計		27,126,589,600	－	26,889,360,337	237,229,263

(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	23,392	34.91	816,614.72	
	BAKER HUGHES CO	77,332	33.11	2,560,462.52	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	152.19	2,754,486.81	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	82.15	696,796.30	
	CHEVRON CORP	133,788	154.22	20,632,785.36	
	CONOCOPHILLIPS	90,080	103.23	9,298,958.40	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	25.24	1,376,741.04	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	48.85	2,455,005.60	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	132.40	1,756,550.80	

EOG RESOURCES INC	43,691	116.20	5,076,894.20	
EQT CORPORATION	27,026	39.71	1,073,202.46	
EXXON MOBIL	301,729	103.16	31,126,363.64	
HALLIBURTON CO	70,302	35.58	2,501,345.16	
HESS CORP	19,804	134.41	2,661,855.64	
HF SINCLAIR CORP	13,429	45.76	614,511.04	
KINDER MORGAN INC	144,061	16.92	2,437,512.12	
MARATHON OIL CORP	50,360	23.52	1,184,467.20	
MARATHON PETROLEUM CORP	32,827	118.02	3,874,242.54	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	53,406	58.61	3,130,125.66	
ONEOK INC	31,321	62.17	1,947,226.57	
OVINTIV INC	14,661	37.93	556,091.73	
PHILLIPS 66	34,260	99.44	3,406,814.40	
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,374	206.40	3,585,993.60	
SCHLUMBERGER	105,564	53.35	5,631,839.40	
TARGA RESOURCES CORP	17,298	77.30	1,337,135.40	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,348.80	718,910.40	
VALERO ENERGY CORP	26,571	114.88	3,052,476.48	
WILLIAMS COS	90,577	32.73	2,964,585.21	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,508	286.84	4,735,154.72	
ALBEMARLE CORP	8,403	237.52	1,995,880.56	
ALCOA CORP	15,500	34.09	528,395.00	
AMCOR PLC	110,292	9.94	1,096,302.48	
AVERY DENNISON CORP	6,638	171.65	1,139,412.70	
BALL CORP	21,539	57.46	1,237,630.94	
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	116.94	1,003,579.08	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,149	71.85	944,755.65	
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	16.29	700,470.00	
CORTEVA INC	51,304	57.30	2,939,719.20	
CROWN HOLDINGS INC	9,940	86.76	862,394.40	
DOW INC	51,372	53.10	2,727,853.20	
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	70.41	2,402,318.79	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	84.96	750,366.72	
ECOLAB INC	18,665	183.40	3,423,161.00	
FMC CORP	8,264	104.25	861,522.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	105,762	38.64	4,086,643.68	
INT'L PAPER CO	25,191	31.80	801,073.80	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	78.59	1,517,337.13	
LINDE PLC	36,447	364.51	13,285,295.97	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	90.50	1,786,922.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,371	440.17	1,923,983.07	
MOSAIC CO/THE	27,732	36.75	1,019,151.00	

NEWMONT CORPORATION	61,808	42.24	2,610,769.92	
NUCOR CORP	18,727	161.95	3,032,837.65	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,893	132.50	780,822.50	
PPG INDUSTRIES INC	17,495	146.77	2,567,741.15	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,126	275.74	1,137,703.24	
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	89.16	932,256.96	
SEALED AIR CORP	11,690	40.94	478,588.60	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,250	255.42	4,661,415.00	
STEEL DYNAMICS INC	11,618	105.16	1,221,748.88	
VULCAN MATERIALS CO	10,153	217.38	2,207,059.14	
WESTLAKE CORP	2,222	120.55	267,862.10	
WESTROCK CO	21,356	29.00	619,324.00	
3 M COMPANY	40,676	97.29	3,957,368.04	
AECOM	10,456	85.81	897,229.36	
AERCAP HOLDINGS NV	11,968	62.74	750,872.32	
ALLEGION PLC	5,598	116.79	653,790.42	
AMETEK INC	17,753	157.08	2,788,641.24	
AXON ENTERPRISE INC	5,367	188.10	1,009,532.70	
BOEING CO	42,311	212.10	8,974,163.10	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	133.10	1,465,431.00	
CARLISLE COS INC	3,456	257.22	888,952.32	
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	49.33	3,061,567.79	
CATERPILLAR	38,381	245.18	9,410,253.58	
CUMMINS INC	10,414	245.80	2,559,761.20	
DEERE&CO	20,925	405.28	8,480,484.00	
DOVER CORP	10,657	146.10	1,556,987.70	
EATON CORP	29,584	198.46	5,871,240.64	
EMERSON ELECTRIC CO	42,473	88.94	3,777,548.62	
FASTENAL CO	44,011	57.87	2,546,916.57	
FERGUSON PLC	14,498	154.79	2,244,145.42	
FORTIVE CORP	25,894	72.35	1,873,430.90	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	69.08	712,214.80	
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	136.08	709,112.88	
GENERAL DYNAMICS CORP	17,004	214.15	3,641,406.60	
GENERAL ELECTRIC CO	81,042	108.27	8,774,417.34	
GRACO INC	13,378	83.57	1,117,999.46	
GRAINGER (WW) INC	3,363	776.18	2,610,293.34	
HEICO CORP	3,640	174.02	633,432.80	
HEICO CORP-CLASS A	4,690	138.20	648,158.00	
HONEYWELL INTL INC	49,482	203.26	10,057,711.32	
HOWMET AEROSPACE INC	26,751	49.40	1,321,499.40	
HUBBELL INC	3,709	327.80	1,215,810.20	

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,482	224.25	556,588.50	
IDEX CORP	5,916	209.98	1,242,241.68	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,658	243.81	5,524,246.98	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	64.26	2,028,174.12	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	49.19	624,713.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	66.90	3,362,795.40	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	194.66	2,857,998.12	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	320.08	808,522.08	
LOCKHEED MARTIN CORP	16,942	458.71	7,771,464.82	
MASCO CORP	15,277	55.21	843,443.17	
NORDSON CORP	4,121	242.29	998,477.09	
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,740	452.45	4,859,313.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	86.86	2,668,078.62	
OWENS CORNING	6,460	127.13	821,259.80	
PACCAR INC	38,842	82.31	3,197,085.02	
PARKER HANNIFIN CORP	9,535	384.17	3,663,060.95	
PENTAIR PLC	10,813	62.84	679,488.92	
QUANTA SERVICES INC	10,250	193.60	1,984,400.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	108,761	97.42	10,595,496.62	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	325.38	2,754,667.08	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	44.41	614,101.48	
SMITH (A.O.) CORP	9,016	70.64	636,890.24	
SNAP-ON INC	4,000	280.73	1,122,920.00	
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	90.18	1,136,087.64	
TEXTRON	13,437	67.53	907,400.61	
TORO CO	8,812	101.16	891,421.92	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,028	189.19	3,221,527.32	
TRANSDIGM GROUP INC	4,084	883.08	3,606,498.72	
UNITED RENTALS INC	5,364	433.57	2,325,669.48	
WABTEC CORP	13,304	109.64	1,458,650.56	
WATSCO INC	2,656	370.38	983,729.28	
XYLEM INC	16,864	109.57	1,847,788.48	
AUTOMATIC DATA PROCESS	30,799	218.74	6,736,973.26	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	112.04	1,035,249.60	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	8,290	163.30	1,353,757.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	65.60	699,820.80	
CINTAS CORP	6,804	480.24	3,267,552.96	
CLARIVATE PLC	27,357	9.30	254,420.10	
COPART INC	31,883	88.11	2,809,211.13	
COSTAR GROUP INC	29,397	86.78	2,551,071.66	
EQUIFAX INC	9,160	225.61	2,066,587.60	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,667	121.23	1,050,700.41	

LEIDOS HOLDINGS	8,529	88.04	750,893.16	
PAYCHEX INC	24,118	113.44	2,735,945.92	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	324.51	1,374,299.85	
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	187.13	640,545.99	
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	150.33	2,473,680.15	
ROBERT HALF INTL INC	7,185	77.53	557,053.05	
ROLLINS INC	17,468	43.16	753,918.88	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	59.49	916,264.98	
TRANSUNION	15,741	76.48	1,203,871.68	
VERISK ANALYTICS INC	10,738	224.97	2,415,727.86	
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	138.80	2,744,770.00	
WASTE MANAGEMENT INC	30,236	170.01	5,140,422.36	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	95.26	797,040.42	
CSX CORP	152,261	33.30	5,070,291.30	
DELTA AIR LINES INC	9,648	47.88	461,946.24	
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	118.90	1,460,092.00	
FEDEX CORP	17,749	251.25	4,459,436.25	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.32	375,196.52	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	179.61	1,032,398.28	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	54.74	745,723.02	
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,920	226.72	3,836,102.40	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,356	369.94	2,721,278.64	
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	37.59	508,705.47	
U-HAUL HOLDING CO	6,606	50.47	333,404.82	
UBER TECHNOLOGIES INC	134,723	42.91	5,780,963.93	
UNION PACIFIC CORP	45,361	202.82	9,200,118.02	
UNITED PARCEL SERVICE B	53,764	179.76	9,664,616.64	
APTIV PLC	19,053	107.55	2,049,150.15	
BORGWARNER INC	19,781	44.95	889,155.95	
FORD MOTOR COMPANY	290,797	14.98	4,356,139.06	
GENERAL MOTORS CO	103,664	39.61	4,106,131.04	
LEAR CORP	3,648	148.63	542,202.24	
LUCID GROUP INC	61,234	7.45	456,193.30	
PHINIA INC	3,956	33.25	131,537.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	24.70	1,267,999.20	
TESLA INC	212,019	274.43	58,184,374.17	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	527.18	1,108,659.54	
DR HORTON INC	22,973	115.39	2,650,854.47	
GARMIN LTD	10,561	105.03	1,109,221.83	
HASBRO INC	10,572	64.56	682,528.32	
LENNAR CORP-CL A	18,864	120.21	2,267,641.44	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	363.74	3,135,075.06	

MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	103.18	429,538.34	
NIKE B	91,582	104.46	9,566,655.72	
NVR INC	247	6,062.78	1,497,506.66	
PULTE GROUP INC	16,747	75.03	1,256,527.41	
VF CORP	25,718	18.66	479,897.88	
WHIRLPOOL CORP	3,785	148.28	561,239.80	
AIRBNB INC-CLASS A	30,729	130.32	4,004,603.28	
ARAMARK	16,686	42.38	707,152.68	
BOOKING HOLDINGS INC	2,799	2,636.91	7,380,711.09	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	49.16	863,249.60	
CARNIVAL CORPORATION	71,810	19.04	1,367,262.40	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,047	2,077.46	4,252,560.62	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	163.45	1,504,884.15	
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	341.68	973,104.64	
DOORDASH INC - A	19,212	77.95	1,497,575.40	
EXPEDIA GROUP INC	11,638	111.88	1,302,059.44	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,175	148.32	2,844,036.00	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	115.61	437,815.07	
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	55.72	1,424,203.20	
MARRIOTT INTL A	19,516	185.66	3,623,340.56	
MCDONALD'S CORP	54,264	292.10	15,850,514.40	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	43.09	980,469.86	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	102.01	1,746,003.16	
STARBUCKS CORP	85,428	96.05	8,205,359.40	
VAIL RESORTS INC	3,014	243.90	735,114.60	
WYNN RESORTS LTD	6,702	101.32	679,046.64	
YUM BRANDS INC	19,972	133.45	2,665,263.40	
ACTIVISION BLIZZARD INC	55,381	82.43	4,565,055.83	
ALPHABET INC-CL A	442,712	119.48	52,895,229.76	
ALPHABET INC-CL C	399,244	120.14	47,965,174.16	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	371.94	2,674,992.48	
COMCAST CORP-CL A	312,679	41.43	12,954,290.97	
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	129.20	2,549,503.60	
FOX CORP - CLASS A	21,544	34.08	734,219.52	
FOX CORP- CLASS B	10,345	31.92	330,212.40	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	37.94	1,081,707.34	
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	81.61	746,976.33	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	74.11	1,139,737.69	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	33.49	454,928.16	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	91.76	1,065,608.88	
MATCH GROUP INC	22,730	42.21	959,433.30	
META PLATFORMS INC-CLASS A	164,626	290.53	47,828,791.78	

NETFLIX INC	33,103	438.10	14,502,424.30	
NEWS CORP-CLASS A	33,479	19.71	659,871.09	
OMNICOM GROUP	14,048	92.99	1,306,323.52	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	16.29	529,555.32	
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	27.45	1,256,304.15	
ROBLOX CORP -CLASS A	28,503	41.15	1,172,898.45	
ROKU INC	9,122	62.83	573,135.26	
SEA LTD-ADR	28,338	54.98	1,558,023.24	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	4.45	269,082.60	
SNAP INC - A	63,578	11.68	742,591.04	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	12,867	143.19	1,842,425.73	
THE WALT DISNEY CO	135,788	88.64	12,036,248.32	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	75.80	2,545,591.40	
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	12.54	2,224,759.02	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	25.52	559,781.20	
ADVANCE AUTO PARTS	4,616	69.38	320,258.08	
AMAZON.COM	686,233	129.78	89,059,318.74	
AUTOZONE INC	1,368	2,469.51	3,378,289.68	
BATH & BODY WORKS INC	13,528	37.66	509,464.48	
BEST BUY COMPANY INC	15,285	79.30	1,212,100.50	
BURLINGTON STORES INC	5,108	154.12	787,244.96	
CARMAX INC	10,695	81.39	870,466.05	
CHEWY INC - CLASS A	6,878	36.70	252,422.60	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	130.66	646,767.00	
EBAY	41,952	44.26	1,856,795.52	
ETSY INC	10,294	82.76	851,931.44	
GENUINE PARTS CO	9,903	165.42	1,638,154.26	
HOME DEPOT	75,273	302.81	22,793,417.13	
LKQ CORP	19,286	57.19	1,102,966.34	
LOWES COMPANIES	44,328	221.94	9,838,156.32	
MERCADOLIBRE INC	3,353	1,153.82	3,868,758.46	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	934.47	4,277,069.19	
POOL CORP	2,664	365.72	974,278.08	
ROSS STORES INC	25,425	107.46	2,732,170.50	
TJX COMPANIES INC	85,671	82.70	7,084,991.70	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	216.86	1,701,483.56	
ULTA BEAUTY INC	3,920	471.63	1,848,789.60	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	21.89	547,250.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	32,965	525.05	17,308,273.25	
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	169.33	2,757,877.71	
DOLLAR TREE INC	16,318	143.54	2,342,285.72	
KROGER CO	50,664	47.17	2,389,820.88	

SYSCO CORP	36,197	74.33	2,690,523.01	
TARGET (DAYTON HUDSON)	34,220	130.05	4,450,311.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	29.10	1,500,599.70	
WALMART INC	110,203	153.49	16,915,058.47	
ALTRIA GROUP INC	132,765	45.98	6,104,534.70	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	78.01	3,168,610.18	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	66.19	1,588,957.14	
BUNGE LIMITED	11,604	100.99	1,171,887.96	
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	45.54	722,674.26	
COCA-COLA CO	305,497	59.76	18,256,500.72	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	64.49	992,759.06	
CONAGRA BRANDS INC	33,324	33.22	1,107,023.28	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,979	253.49	3,036,556.71	
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	62.86	832,392.12	
GENERAL MILLS INC	43,531	75.17	3,272,225.27	
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	242.98	2,658,687.16	
HORMEL FOODS CORP	23,338	39.35	918,350.30	
JM SMUCKER CO	7,850	147.71	1,159,523.50	
KELLOGG CO	18,819	67.19	1,264,448.61	
KEURIG DR PEPPER INC	65,371	31.76	2,076,182.96	
KRAFT HEINZ CO/THE	56,982	35.46	2,020,581.72	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	112.62	1,337,475.12	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	84.67	1,531,849.64	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	65.92	966,980.48	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	101,324	72.00	7,295,328.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	55.87	3,259,902.76	
PEPSICO INC	102,377	183.08	18,743,181.16	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,372	97.70	11,271,844.40	
TYSON FOODS INC	23,306	51.76	1,206,318.56	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	98.97	1,914,673.62	
CLOROX COMPANY	9,570	157.99	1,511,964.30	
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,761	75.59	4,441,743.99	
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,973	192.46	3,266,623.58	
KIMBERLY-CLARK CORP	24,643	135.36	3,335,676.48	
PROCTER & GAMBLE CO	175,356	148.80	26,092,972.80	
ABBOTT LABORATORIES	129,183	106.35	13,738,612.05	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	329.54	1,731,073.62	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,469	190.86	2,379,833.34	
BAXTER INTERNATIONAL	34,687	45.30	1,571,321.10	
BECTON DICKINSON & CO	21,103	256.92	5,421,782.76	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,838	52.29	5,586,559.02	
CARDINAL HEALTH	19,151	93.97	1,799,619.47	

CENTENE CORP	40,934	66.50	2,722,111.00	
CVS HEALTH CORP	95,131	69.17	6,580,211.27	
DAVITA INC	4,627	103.89	480,699.03	
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	38.83	690,164.42	
DEXCOM INC	28,772	126.71	3,645,700.12	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	45,052	90.26	4,066,393.52	
ELEVANCE HEALTH INC	17,637	429.40	7,573,327.80	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	79.62	2,382,310.02	
HCA HEALTHCARE INC	15,457	291.49	4,505,560.93	
HENRY SCHEIN INC	8,755	78.66	688,668.30	
HOLOGIC INC	18,875	77.51	1,463,001.25	
HUMANA INC	9,297	430.14	3,999,011.58	
IDEXX LABORATORIES INC	6,168	498.01	3,071,725.68	
INSULET CORP	5,246	278.67	1,461,902.82	
INTUITIVE SURGICAL INC	26,035	331.29	8,625,135.15	
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	208.28	1,363,817.44	
MASIMO CORP	2,669	158.61	423,330.09	
MCKESSON CORP	10,179	414.80	4,222,249.20	
MEDTRONIC PLC	98,891	85.89	8,493,747.99	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	295.23	1,341,820.35	
NOVOCURE LTD	7,933	41.08	325,887.64	
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	139.00	1,206,381.00	
RESMED INC	10,920	215.80	2,356,536.00	
STERIS PLC	6,933	217.85	1,510,354.05	
STRYKER CORP	25,363	294.27	7,463,570.01	
TELEFLEX INC	3,934	235.92	928,109.28	
THE CIGNA GROUP	22,079	277.12	6,118,532.48	
THE COOPER COS INC	3,504	378.38	1,325,843.52	
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,339	461.58	32,005,495.62	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	150.96	705,285.12	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	194.62	2,190,448.10	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	140.86	2,148,678.44	
ABBVIE INC	131,130	135.50	17,768,115.00	
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	117.00	2,549,547.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	192.68	1,858,013.24	
AMGEN	39,709	218.65	8,682,372.85	
AVANTOR INC	49,647	20.73	1,029,182.31	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	386.12	715,480.36	
BIO-TECHNE CORP	12,980	80.80	1,048,784.00	
BIOGEN INC	10,740	275.07	2,954,251.80	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	85.07	1,257,589.81	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	156,340	62.65	9,794,701.00	

CATALENT INC	13,739	44.68	613,858.52	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	206.89	869,765.56	
DANAHER CORP	51,486	233.08	12,000,356.88	
ELI LILLY & CO	60,041	452.08	27,143,335.28	
EXACT SCIENCES CORP	12,208	90.57	1,105,678.56	
GILEAD SCIENCES INC	92,825	74.42	6,908,036.50	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	15,618	102.70	1,603,968.60	
ILLUMINA INC	11,423	183.32	2,094,064.36	
INCYTE CORP	15,212	62.07	944,208.84	
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	216.81	2,999,783.16	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	122.00	606,462.00	
JOHNSON & JOHNSON	193,140	159.25	30,757,545.00	
MERCK & CO	188,628	109.00	20,560,452.00	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,269.09	2,064,809.43	
MODERNA INC	24,153	118.87	2,871,067.11	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	94.02	633,882.84	
PFIZER	419,551	35.53	14,906,647.03	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,992	692.45	5,534,060.40	
REPLIGEN CORP	4,353	141.54	616,123.62	
REVVITY INC	8,524	116.32	991,511.68	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	30.01	902,790.83	
SEAGEN INC	9,758	191.51	1,868,754.58	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	7.96	733,442.36	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,670	513.73	14,728,639.10	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	211.82	766,364.76	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,147	338.18	6,475,132.46	
VIATRIS INC	89,720	9.86	884,639.20	
WATERS CORP	4,749	264.15	1,254,448.35	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	371.60	2,143,017.20	
ZOETIS INC	34,383	167.14	5,746,774.62	
BANK OF AMERICA CORP	535,131	28.53	15,267,287.43	
CITIGROUP	144,682	45.74	6,617,754.68	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	26.93	1,064,327.46	
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	26.65	1,450,293.00	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,284.88	984,218.08	
FIRST HORIZON CORP	44,308	11.83	524,163.64	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	10.89	1,242,679.68	
JPMORGAN CHASE & CO	217,897	144.34	31,451,252.98	
KEY CORP	71,223	9.59	683,028.57	
M & T BANK CORP	11,807	128.56	1,517,907.92	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,658	125.61	3,725,341.38	
REGIONS FINL CORP	70,810	18.33	1,297,947.30	

TRUIST FINANCIAL CORP	96,574	31.88	3,078,779.12	
US BANCORP	113,859	33.54	3,818,830.86	
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	38.86	554,648.78	
WELLS FARGO & CO	279,720	42.77	11,963,624.40	
ALLY FINANCIAL INC	21,529	26.63	573,317.27	
AMERICAN EXPRESS	47,011	169.80	7,982,467.80	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	332.62	2,599,757.92	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	28,767	76.01	2,186,579.67	
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	94.88	1,212,566.40	
BANK NEW YORK CO	61,254	44.38	2,718,452.52	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	96,495	340.90	32,895,145.50	
BLACKROCK INC	11,143	684.10	7,622,926.30	
BLACKSTONE INC	52,505	91.91	4,825,734.55	
BLOCK INC	39,463	67.27	2,654,676.01	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,372	108.04	2,957,270.88	
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	31.73	497,177.37	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,144	135.84	970,440.96	
CME GROUP INC	26,740	181.95	4,865,343.00	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,895	78.72	857,654.40	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	116.94	2,220,339.78	
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	27.23	761,977.09	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	387.57	1,220,070.36	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	42,810	59.27	2,537,348.70	
FISERV INC	46,319	125.20	5,799,138.80	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,064	253.49	1,283,673.36	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	26.15	681,730.50	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	42.34	182,739.44	
GLOBAL PAYMENTS INC	18,535	105.85	1,961,929.75	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,812	315.17	7,819,998.04	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	41,604	112.29	4,671,713.16	
INVESCO LTD	26,420	16.92	447,026.40	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	163.01	849,771.13	
KKR & CO INC	44,805	54.87	2,458,450.35	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,307	224.82	1,193,119.74	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	248.10	795,656.70	
MASTERCARD INC-CLASS A	63,267	388.68	24,590,617.56	
MOODY'S CORP	12,261	339.57	4,163,467.77	
MORGAN STANLEY	93,231	83.36	7,771,736.16	
MSCI INC	5,952	471.75	2,807,856.00	
NASDAQ INC	24,183	48.97	1,184,241.51	
NORTHERN TRUST CORP	15,902	74.32	1,181,836.64	
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	66.79	5,295,511.94	

PRICE T ROWE GROUP INC	15,806	110.23	1,742,295.38	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	104.33	1,615,654.38	
S&P GLOBAL INC	24,377	393.25	9,586,255.25	
SCHWAB (CHARLES) CORP	111,693	56.79	6,343,045.47	
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	59.19	565,264.50	
STATE STREET CORP	26,059	73.88	1,925,238.92	
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	33.61	981,277.56	
TOAST INC-CLASS A	20,341	22.49	457,469.09	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	65.60	594,401.60	
VISA INC-CLASS A SHARES	120,784	236.45	28,559,376.80	
AFLAC	43,196	70.04	3,025,447.84	
ALLSTATE CORP	18,556	108.27	2,009,058.12	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	119.43	754,678.17	
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	58.20	3,173,878.80	
AON PLC	15,249	335.41	5,114,667.09	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26,510	74.79	1,982,682.90	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,913	214.05	3,406,177.65	
ASSURANT INC	4,726	125.86	594,814.36	
BROWN & BROWN INC	16,344	67.80	1,108,123.20	
CHUBB LTD	30,784	191.53	5,896,059.52	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	98.17	1,090,668.70	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	205.44	444,983.04	
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	351.28	1,155,008.64	
FNF GROUP	20,461	35.76	731,685.36	
GLOBE LIFE INC	5,948	111.66	664,153.68	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	72.73	1,798,685.63	
LOEWS CORP	12,757	60.45	771,160.65	
MARKEL GROUP INC	1,007	1,377.90	1,387,545.30	
MARSH & MCLENNAN COS	36,799	183.99	6,770,648.01	
METLIFE INC	48,925	57.61	2,818,569.25	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	76.62	1,420,228.32	
PROGRESSIVE CORP	43,513	131.26	5,711,516.38	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,521	89.85	2,382,911.85	
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	171.65	2,943,282.55	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,429	230.84	1,714,910.36	
WR BERKLEY CORP	17,572	59.86	1,051,859.92	
WEYERHAEUSER CO	52,615	33.45	1,759,971.75	
ACCENTURE PLC-CL A	46,943	305.76	14,353,291.68	
ADOBE INC	34,096	485.27	16,545,765.92	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	11,484	89.77	1,030,918.68	
ANSYS INC	6,794	320.17	2,175,234.98	
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	169.14	404,921.16	

ATLASSIAN CORP-CL A	10,436	169.45	1,768,380.20	
AUTODESK INC	15,965	201.57	3,218,065.05	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	51.47	762,425.11	
BILL HOLDINGS,INC.	7,443	115.60	860,410.80	
BLACK KNIGHT INC	11,543	60.26	695,581.18	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	20,308	226.89	4,607,682.12	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,186	125.03	773,435.58	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	62.36	1,264,847.88	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,307	65.34	2,372,299.38	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,571	144.05	2,387,052.55	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	155.64	482,484.00	
DATADOG INC - CLASS A	17,716	98.02	1,736,522.32	
DOCUSIGN INC	14,969	49.70	743,959.30	
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	26.97	622,143.96	
DYNATRACE INC	14,790	51.14	756,360.60	
EPAM SYSTEMS INC	4,768	229.20	1,092,825.60	
FAIR ISAAC CORP	1,816	793.79	1,441,522.64	
FORTINET INC	48,642	74.68	3,632,584.56	
GARTNER INC	5,655	347.74	1,966,469.70	
GEN DIGITAL INC	43,555	18.08	787,474.40	
GODADDY INC - CLASS A	11,388	75.52	860,021.76	
HUBSPOT INC	3,646	512.86	1,869,887.56	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,426	132.08	8,905,626.08	
INTUIT INC	20,854	448.19	9,346,554.26	
MICROSOFT CORP	525,636	337.22	177,254,971.92	
MONDAY.COM LTD	231	161.86	37,389.66	
MONGODB INC	5,325	388.62	2,069,401.50	
OKTA INC	11,505	68.53	788,437.65	
ORACLE CORP	120,407	114.61	13,799,846.27	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	130,741	15.34	2,005,566.94	
PALO ALTO NETWORKS INC	22,493	247.59	5,569,041.87	
PTC INC	8,226	137.25	1,129,018.50	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,898	476.41	3,762,686.18	
SALESFORCE INC	74,331	209.59	15,579,034.29	
SERVICENOW INC	15,145	552.98	8,374,882.10	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,326	170.61	3,297,208.86	
SPLUNK INC	11,101	104.41	1,159,055.41	
SYNOPSYS INC	11,321	431.29	4,882,634.09	
TWILIO INC - A	12,842	62.45	801,982.90	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	406.48	1,357,236.72	
UIPATH INC - CLASS A	28,419	16.49	468,629.31	
UNITY SOFTWARE INC	16,437	40.46	665,041.02	

VERISIGN INC	6,723	222.45	1,495,531.35	
VMWARE INC-CLASS A	17,149	141.40	2,424,868.60	
WIX.COM LTD	5,010	76.14	381,461.40	
WORKDAY INC-CLASS A	15,164	218.73	3,316,821.72	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,547	65.67	1,086,641.49	
ZSCALER INC	7,204	143.18	1,031,468.72	
AMPHENOL CORPORATION	44,247	83.62	3,699,934.14	
APPLE INC	1,176,051	190.68	224,249,404.68	
ARISTA NETWORKS INC	19,289	158.00	3,047,662.00	
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	143.78	623,717.64	
CDW CORP/DE	9,584	183.33	1,757,034.72	
CISCO SYSTEMS	304,444	50.99	15,523,599.56	
COGNEX CORP	14,352	54.23	778,308.96	
CORNING	58,221	34.70	2,020,268.70	
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	53.53	970,177.72	
F5 INC	4,851	143.42	695,730.42	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	16.87	1,643,677.84	
HP INC	68,329	31.13	2,127,081.77	
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	31.08	786,976.68	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	163.77	2,266,249.26	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,202	291.87	3,561,397.74	
NETAPP INC	15,191	76.25	1,158,313.75	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,756	60.28	768,931.68	
TE CONNECTIVITY LTD	22,795	139.82	3,187,196.90	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	409.97	1,361,100.40	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	52.07	922,576.26	
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	37.67	971,509.30	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	295.22	1,228,705.64	
AT&T INC	529,966	15.61	8,272,769.26	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	17.80	276,184.80	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	18.74	353,605.06	
T-MOBILE US INC	44,785	138.97	6,223,771.45	
VERIZON COMMUNICATIONS	312,179	35.90	11,207,226.10	
AES CORP	54,375	21.09	1,146,768.75	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	52.63	1,093,546.14	
AMEREN CORPORATION	20,898	82.26	1,719,069.48	
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,118	84.29	3,128,676.22	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	141.06	2,040,856.08	
ATMOS ENERGY CORP	11,302	117.31	1,325,837.62	
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	29.48	1,399,297.68	
CMS ENERGY CORP	23,697	59.30	1,405,232.10	
CONSOLIDATED EDISON INC	24,527	92.03	2,257,219.81	

CONSTELLATION ENERGY	25,114	91.33	2,293,661.62	
DOMINION ENERGY INC	60,549	52.24	3,163,079.76	
DTE ENERGY COMPANY	15,851	109.99	1,743,451.49	
DUKE ENERGY CORP	57,283	89.77	5,142,294.91	
EDISON INTL	25,571	68.86	1,760,819.06	
ENTERGY CORP	16,181	97.46	1,577,000.26	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	39.15	798,620.85	
EVERGY INC	18,475	58.69	1,084,297.75	
EVERSOURCE ENERGY	27,450	70.83	1,944,283.50	
EXELON CORP	73,907	40.96	3,027,230.72	
FIRSTENERGY CORP	39,425	38.77	1,528,507.25	
NEXTERA ENERGY INC	150,399	72.05	10,836,247.95	
NISOURCE INC	32,351	27.52	890,299.52	
NRG ENERGY INC	19,068	38.12	726,872.16	
PG&E CORP	129,525	17.40	2,253,735.00	
PPL CORPORATION	58,459	26.21	1,532,210.39	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	35,683	62.54	2,231,614.82	
SEMPRA ENERGY	22,943	144.13	3,306,774.59	
SOUTHERN CO	81,133	70.68	5,734,480.44	
UGI CORP	18,019	25.95	467,593.05	
VISTRA CORP	22,676	26.70	605,449.20	
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	88.98	2,086,314.06	
XCEL ENERGY INC	39,963	62.93	2,514,871.59	
ADVANCED MICRO DEVICES	119,628	113.17	13,538,300.76	
ANALOG DEVICES	37,601	185.31	6,967,841.31	
APPLIED MATERIALS	62,818	139.57	8,767,508.26	
BROADCOM INC	30,991	846.75	26,241,629.25	
ENPHASE ENERGY INC	9,617	166.17	1,598,056.89	
ENTEGRIS INC	10,321	105.84	1,092,374.64	
FIRST SOLAR INC	7,921	189.14	1,498,177.94	
INTEL CORP	310,036	31.85	9,874,646.60	
KLA CORP	10,294	455.83	4,692,314.02	
LAM RESEARCH CORP	10,237	617.87	6,325,135.19	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	91.65	1,006,133.70	
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,694	59.15	3,767,500.10	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	86.62	3,526,993.16	
MICRON TECHNOLOGY	81,347	60.65	4,933,695.55	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	513.90	1,814,580.90	
NVIDIA CORP	183,596	425.03	78,033,807.88	
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	204.06	3,940,398.60	
ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	93.30	2,986,626.30	
QORVO INC	6,249	100.23	626,337.27	

	QUALCOMM	82,879	115.94	9,608,991.26	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	108.34	1,217,958.28	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,156	258.94	1,076,154.64	
	TERADYNE INC	12,318	106.34	1,309,896.12	
	TEXAS INSTRUMENTS	67,444	173.70	11,715,022.80	
	WOLFSPEED INC	10,256	63.64	652,691.84	
	CBRE GROUP INC-A	22,995	81.87	1,882,600.65	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.81	376,047.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,809	47.82	421,246.38	
アメリカドル 小計		25,330,053		2,832,878,505.22 (403,798,502,134)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	37,400	18.38	687,412.00	
	CAMECO CORP	31,793	39.34	1,250,736.62	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,307	74.17	6,104,710.19	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	23.02	2,561,964.86	
	ENBRIDGE	150,513	48.38	7,281,818.94	
	IMPERIAL OIL	16,488	65.42	1,078,644.96	
	KEYERA CORP	18,607	30.66	570,490.62	
	PARKLAND CORP	4,564	33.00	150,612.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	40.50	1,544,305.50	
	SUNCOR ENERGY	98,973	38.82	3,842,131.86	
	TC ENERGY CORP	75,669	52.00	3,934,788.00	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	64.01	1,600,826.09	
	AGNICO EAGLE MINES	36,100	64.26	2,319,786.00	
	BARRICK GOLD CORP	133,727	21.71	2,903,213.17	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,275	64.39	532,827.25	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	31.84	1,380,582.40	
	FRANCO-NEVADA CORP	13,695	184.25	2,523,303.75	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	12.33	639,273.51	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	6.10	661,551.10	
	LUNDIN MINING CORP	31,977	10.74	343,432.98	
	NUTRIEN LTD	37,152	80.86	3,004,110.72	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	19.12	428,593.92	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	54.65	1,933,844.90	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	112.27	393,506.35	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	55.21	1,761,530.26	
	CAE INC	25,999	28.86	750,331.14	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	108.65	566,392.45	
	WSP GLOBAL INC	9,951	170.79	1,699,531.29	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,971	51.05	713,219.55	
	RB GLOBAL INC	14,445	78.26	1,130,465.70	
	THOMSON REUTERS CORP	11,033	172.36	1,901,647.88	

AIR CANADA	13,805	24.81	342,502.05	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	153.52	6,484,224.24	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	69,248	104.03	7,203,869.44	
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	148.96	869,479.52	
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	77.25	1,564,621.50	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	108.08	331,805.60	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	42.50	417,350.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	100.20	2,311,914.60	
QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.10	503,120.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	181.87	820,779.31	
DOLLARAMA INC	22,000	87.10	1,916,200.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	56,821	65.26	3,708,138.46	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	36.86	255,439.80	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	118.66	1,532,256.58	
METRO INC	18,840	73.09	1,377,015.60	
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	153.02	799,682.52	
SAPUTO INC	20,898	28.15	588,278.70	
BANK MONTREAL	52,757	119.15	6,285,996.55	
BANK NOVA SCOTIA	88,533	63.95	5,661,685.35	
CANADIAN IMPERIAL BANK	67,344	55.84	3,760,488.96	
NATIONAL BANK OF CANADA	24,111	98.21	2,367,941.31	
ROYAL BANK OF CANADA	103,016	125.52	12,930,568.32	
TORONTO-DOMINION BANK	135,406	80.88	10,951,637.28	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	42.37	1,228,772.37	
BROOKFIELD CORP	104,769	43.29	4,535,450.01	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	19.97	650,602.63	
IGM FINANCIAL INC	7,685	40.14	308,475.90	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	38.75	166,663.75	
ONEX CORP	6,603	73.35	484,330.05	
TMX GROUP LTD	23,425	29.23	684,712.75	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	962.57	1,688,347.78	
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.71	920,833.48	
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	91.01	634,976.77	
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	199.30	2,641,721.50	
MANULIFE FINANCIAL CORP	130,818	24.60	3,218,122.80	
POWER CORP OF CANADA	43,577	36.46	1,588,817.42	
SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	67.63	2,949,614.82	
CGI INC - CL A	16,084	138.05	2,220,396.20	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,490	2,659.64	3,962,863.60	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	103.28	721,307.52	
OPEN TEXT CORP	20,463	52.57	1,075,739.91	
SHOPIFY INC - CLASS A	88,987	81.90	7,288,035.30	

	BCE INC	6,203	59.54	369,326.62	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	60.20	1,678,436.20	
	TELUS CORP	32,908	25.76	847,710.08	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	10.47	542,534.46	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	23.82	581,088.90	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	41.45	468,177.75	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	33.82	349,157.68	
	EMERA INC	17,459	53.76	938,595.84	
	FORTIS INC	35,547	55.98	1,989,921.06	
	HYDRO ONE LTD	20,587	37.11	763,983.57	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	26.67	476,166.18	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	203.15	546,473.50	
カナダドル 小計		3,016,123		175,701,938.05 (18,852,817,952)	
ユーロ	ENI	174,687	13.05	2,280,014.72	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	10.80	428,349.60	
	NESTE OIL OYJ	32,766	35.65	1,168,107.90	
	OMV AG	12,549	40.03	502,336.47	
	REPSOL SA	89,536	12.74	1,141,136.32	
	TENARIS SA	40,648	13.63	554,235.48	
	TOTALENERGIES SE	175,847	51.10	8,985,781.70	
	AIR LIQUIDE	38,920	154.78	6,024,037.60	
	AKZO NOBEL	12,357	72.16	891,681.12	
	ARCELORMITTAL	32,320	24.02	776,488.00	
	ARKEMA	4,369	88.20	385,345.80	
	BASF SE	64,204	45.25	2,905,231.00	
	COVESTRO AG	14,454	47.87	691,912.98	
	CRH PLC	55,581	49.01	2,724,024.81	
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	99.21	1,359,871.47	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.73	284,416.19	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	68.08	732,881.20	
	OCI NV	7,248	22.29	161,557.92	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	31.08	606,184.32	
	SOLVAY SA	5,356	102.30	547,918.80	
	STORA ENSO OYJ R	42,169	10.85	457,744.49	
	SYMRISE AG	10,018	93.50	936,683.00	
	UMICORE	17,605	25.71	452,624.55	
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	27.70	1,172,374.80	
	VOESTALPINE AG	7,152	31.62	226,146.24	
	WACKER CHEMIE AG	1,770	126.45	223,816.50	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	15,622	29.42	459,599.24	
	ACS ACTIVIDADES DE CO-RIGHTS	15,622	1.46	22,878.41	

AIRBUS SE	44,063	131.10	5,776,659.30	
ALSTOM	24,388	25.42	619,942.96	
BOUYGUES ORD	16,606	29.37	487,718.22	
BRENNTAG SE	12,514	68.98	863,215.72	
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	13.08	1,060,225.21	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	34,575	32.03	1,107,437.25	
DASSAULT AVIATION SA	2,130	180.00	383,400.00	
EIFFAGE	5,924	92.76	549,510.24	
FERROVIAL SE	37,026	28.57	1,057,832.82	
GEA GROUP AG	13,382	36.63	490,182.66	
IMCD NV	4,641	129.10	599,153.10	
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	57.04	707,181.92	
KNORR-BREMSE AG	5,022	64.36	323,215.92	
KONE OYJ-B	26,369	46.31	1,221,148.39	
LEGRAND SA	19,340	87.80	1,698,052.00	
METSO CORPORATION	51,970	10.96	569,851.05	
MTU AERO ENGINES AG	3,962	223.10	883,922.20	
PRYSMIAN SPA	21,155	36.84	779,350.20	
RATIONAL AG	483	642.00	310,086.00	
RHEINMETALL AG	2,795	242.20	676,949.00	
SAFRAN SA	24,910	134.84	3,358,864.40	
SAINT-GOBAIN	36,177	53.68	1,941,981.36	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,328	156.92	6,328,269.76	
SIEMENS	56,492	142.62	8,056,889.04	
SIEMENS ENERGY AG	36,841	14.91	549,299.31	
THALES SA	8,524	131.90	1,124,315.60	
VINCI S.A.	39,327	102.40	4,027,084.80	
WARTSILA OYJ	41,917	9.91	415,732.80	
BUREAU VERITAS SA	25,073	23.41	586,958.93	
RANDSTAD NV	6,064	48.81	295,983.84	
TELEPERFORMANCE	4,734	145.00	686,430.00	
WOLTERS KLUWER	18,738	109.60	2,053,684.80	
ADP	2,382	128.00	304,896.00	
AENA SME SA	5,508	145.05	798,935.40	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	9.01	408,857.83	
DHL GROUP	74,810	43.96	3,288,647.60	
GETLINK	21,115	15.73	332,244.52	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,611	107.14	2,636,822.54	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	99.75	497,852.25	
CONTINENTAL AG	8,168	68.44	559,017.92	
DR ING HC F PORSCHE AG	7,331	110.35	808,975.85	
FERRARI NV	9,370	288.20	2,700,434.00	

MERCEDES-BENZ GROUP AG	63,618	71.95	4,577,315.10	
MICHELIN	47,236	26.36	1,245,140.96	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	52.60	617,787.00	
RENAULT SA	11,597	37.77	438,076.67	
STELLANTIS NV	162,367	16.20	2,631,644.33	
VALEO SA	16,596	19.55	324,451.80	
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	122.36	1,875,534.08	
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	152.95	380,233.70	
ADIDAS AG	11,414	166.62	1,901,800.68	
HERMES INTERNATIONAL	2,355	1,862.20	4,385,481.00	
KERING	5,534	477.60	2,643,038.40	
LVMH	20,525	825.40	16,941,335.00	
MONCLER SPA	14,605	61.60	899,668.00	
PUMA SE	9,220	51.94	478,886.80	
SEB SA	2,282	91.70	209,259.40	
ACCOR	14,436	33.35	481,440.60	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	32,105	65.76	2,111,224.80	
DELIVERY HERO SE	13,414	39.46	529,383.51	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,042	172.45	2,249,092.90	
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	13.44	209,381.11	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	34.84	282,482.72	
SODEXO	6,173	96.06	592,978.38	
BOLLORE SE	83,646	5.62	470,090.52	
PUBLICIS GROUPE	17,217	70.02	1,205,534.34	
SCOUT24 SE	3,716	56.90	211,440.40	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	20.70	1,362,598.20	
VIVENDI SE	61,243	8.45	517,870.80	
D'IETEREN GROUP	2,217	156.30	346,517.10	
INDITEX	81,082	34.08	2,763,274.56	
PROSUS	59,578	64.20	3,824,907.60	
ZALANDO SE	17,664	24.69	436,124.16	
CARREFOUR	39,746	16.88	671,111.21	
HELLOFRESH SE	13,805	24.50	338,222.50	
JERONIMO MARTINS	14,298	25.48	364,313.04	
KESKO OYJ-B SHS	20,083	17.39	349,343.78	
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	31.21	2,212,789.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,422	50.63	3,211,055.86	
DANONE (GROUPE)	47,639	55.26	2,632,531.14	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	12.43	421,086.40	
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	78.90	750,496.80	
HEINEKEN NV	20,157	94.66	1,908,061.62	
JDE PEET'S BV	7,000	27.00	189,000.00	

KERRY GROUP PLC-A	10,592	88.58	938,239.36	
PERNOD-RICARD	15,339	196.40	3,012,579.60	
REMY COINTREAU	1,032	141.35	145,873.20	
BEIERSDORF AG	7,430	116.50	865,595.00	
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	61.86	543,130.80	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,415	70.26	802,017.90	
LOREAL	17,902	402.65	7,208,240.30	
AMPLIFON SPA	11,650	30.29	352,878.50	
BIOMERIEUX	3,044	90.90	276,699.60	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	97.72	335,179.60	
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	91.50	189,405.00	
ESSILORLUXOTTICA	21,384	170.98	3,656,236.32	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	42.88	728,316.80	
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	24.64	830,096.96	
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	19.64	1,411,217.60	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	49.58	1,069,291.86	
ARGENX SE	4,177	348.20	1,454,431.40	
BAYER	72,310	48.76	3,525,835.60	
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	56.74	579,882.80	
GRIFOLS SA	27,685	12.25	339,279.67	
IPSEN	3,532	108.30	382,515.60	
MERCK KGAA	9,080	146.50	1,330,220.00	
ORION OYJ-CLASS B	3,129	36.21	113,301.09	
QIAGEN N.V.	17,038	40.76	694,468.88	
RECORDATI SPA	5,163	41.96	216,639.48	
SANOFI	84,347	93.95	7,924,400.65	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	309.40	564,345.60	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,574	223.60	351,946.40	
UCB (GROUPE)	9,389	78.34	735,534.26	
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	14.72	407,661.62	
AIB GROUP PLC	88,299	3.86	341,187.33	
BANCO BILBAO VIZCAYA	441,393	6.89	3,042,963.34	
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	3.26	3,991,973.18	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	8.95	791,336.61	
BNP PARIBAS	82,574	55.12	4,551,478.88	
CAIXABANK	336,789	3.69	1,243,424.98	
COMMERZBANK AG	81,889	10.30	843,456.70	
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	10.59	1,053,406.17	
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	31.79	806,703.04	
FINECOBANK SPA	41,585	12.85	534,367.25	
ING GROEP NV-CVA	269,040	12.37	3,330,177.12	
INTESA SANPAOLO	1,247,505	2.34	2,930,389.24	

KBC GROEP NV	18,057	64.42	1,163,231.94	
MEDIOBANCA	25,262	11.01	278,134.62	
SOCIETE GENERALE	53,019	23.30	1,235,607.79	
UNICREDIT SPA	139,080	21.28	2,959,622.40	
ADYEN NV	1,609	1,462.00	2,352,358.00	
AMUNDI SA	4,626	53.65	248,184.90	
DEUTSCHE BANK NAMEN	134,445	9.27	1,247,111.82	
DEUTSCHE BOERSE	14,123	161.20	2,276,627.60	
EDENRED	20,131	57.94	1,166,390.14	
EURAZEO SA	3,357	61.05	204,944.85	
EURONEXT NV	6,480	61.25	396,900.00	
EXOR NV	7,825	79.44	621,618.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	69.80	594,347.00	
NEXI SPA	48,458	7.59	367,893.13	
SOFINA	1,238	187.30	231,877.40	
WENDEL	2,023	91.15	184,396.45	
WORLDLINE SA	20,332	34.18	694,947.76	
AEGON	148,741	4.69	697,595.29	
AGEAS	11,086	36.51	404,749.86	
ALLIANZ SE-REG	29,979	204.00	6,115,716.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	71,236	18.44	1,313,948.02	
AXA SA	136,364	25.35	3,456,827.40	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	187.25	834,198.75	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	327.90	3,414,750.60	
NN GROUP NV	16,208	33.28	539,402.24	
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.77	449,854.02	
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	39.96	1,323,954.72	
TALANX AG	5,053	51.65	260,987.45	
BECHTLE AG	7,659	36.17	277,026.03	
CAPGEMINI SA	12,235	169.45	2,073,220.75	
DASSAULT SYSTEMES SA	47,353	39.06	1,849,608.18	
NEMETSCHEK SE	5,455	62.00	338,210.00	
SAP SE	77,618	121.44	9,425,929.92	
NOKIA OYJ	396,129	3.82	1,514,401.16	
CELLNEX TELECOM SA	41,890	36.25	1,518,512.50	
DEUTSCHE TELEKOM	240,920	19.50	4,697,940.00	
ELISA A	10,227	47.71	487,930.17	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.66	354,324.37	
KPN (KON.)	216,358	3.23	699,701.77	
ORANGE	128,563	10.33	1,328,312.91	
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.25	216,633.46	
TELEFONICA	373,259	3.63	1,355,303.42	

	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.38	235,139.13	
	ACCIONA SA	2,181	138.20	301,414.20	
	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	28.02	152,344.74	
	E.ON SE	166,881	11.30	1,886,589.70	
	EDP RENOVAVEIS SA	21,752	17.20	374,134.40	
	ELIA GROUP SA/NV	987	111.00	109,557.00	
	ENAGAS	21,663	15.99	346,499.68	
	ENDESA	25,972	19.43	504,635.96	
	ENEL	596,378	6.09	3,636,116.66	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	273,128	4.35	1,189,199.31	
	ENGIE	129,254	15.09	1,950,959.87	
	FORTUM OYJ	32,550	12.17	396,133.50	
	IBERDROLA SA	432,701	11.18	4,839,760.68	
	IBERDROLA SA-RTS	432,701	0.29	129,031.43	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.00	260,260.00	
	REDEIA CORP SA	30,678	14.87	456,335.25	
	RWE STAMM	44,929	39.05	1,754,477.45	
	SNAM SPA	147,559	4.60	679,361.63	
	TERNA SPA	95,819	7.46	715,193.01	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	28.52	1,419,754.12	
	VERBUND AG	6,430	71.20	457,816.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,400	372.35	1,265,990.00	
	ASML HOLDING NV	29,993	640.40	19,207,517.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES	97,070	35.74	3,469,767.15	
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	43.80	2,202,526.80	
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	53.50	282,212.50	
	VONOVIA SE	52,580	17.78	935,135.30	
ユーロ 小計		14,094,279		344,000,020.06 (53,767,203,135)	
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.53	5,965,366.26	
	SHELL PLC-NEW	508,994	22.82	11,617,788.05	
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	22.01	2,054,127.27	
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	14.15	422,611.68	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	55.62	607,592.88	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	18.30	322,153.20	
	GLENCORE PLC	793,369	4.36	3,461,865.63	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	17.07	287,595.36	
	MONDI PLC	41,710	12.14	506,567.95	
	RIO TINTO PLC REG	83,678	49.15	4,112,773.70	
	ASHTEAD GROUP PLC	33,317	50.94	1,697,167.98	
	BAE SYSTEMS PLC	219,532	8.88	1,949,883.22	
	BUNZL PLC	22,799	28.75	655,471.25	

DCC PLC	6,622	42.03	278,322.66	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.48	944,324.86	
SMITHS GROUP PLC	26,476	15.80	418,320.80	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	99.74	549,966.36	
EXPERIAN PLC	67,859	28.60	1,940,767.40	
INTERTEK GROUP PLC	13,890	39.98	555,322.20	
RELX PLC	141,442	24.63	3,483,716.46	
RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	5.94	1,081,184.96	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.02	294,784.45	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	38.72	269,181.44	
BURBERRY GROUP PLC	29,776	20.33	605,346.08	
PERSIMMON PLC	25,686	9.74	250,335.75	
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.00	265,292.46	
COMPASS GROUP PLC	129,701	20.70	2,684,810.70	
ENTAIN PLC	49,630	12.17	603,997.10	
INTERCONTINENTAL HOTELS	11,363	52.54	597,012.02	
PEARSON	55,305	8.17	452,284.29	
WHITBREAD PLC	17,434	33.09	576,891.06	
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.97	432,887.98	
INFORMA PLC	110,598	7.05	780,600.68	
WPP PLC	85,821	8.14	698,754.58	
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.41	291,623.25	
KINGFISHER PLC	153,717	2.24	344,479.79	
NEXT PLC	7,832	66.58	521,454.56	
OCADO GROUP PLC	54,753	5.92	324,137.76	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.70	401,246.17	
TESCO PLC	525,585	2.46	1,295,041.44	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	19.91	512,612.10	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,888	25.74	4,064,037.12	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	23.72	426,011.20	
DIAGEO	167,595	32.70	5,480,356.50	
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	17.44	1,194,256.32	
HALEON PLC	346,790	3.08	1,070,887.52	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	52,885	57.42	3,036,656.70	
UNILEVER PLC	187,760	39.90	7,492,562.80	
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.63	798,102.82	
ASTRAZENECA	115,201	101.10	11,646,821.10	
GSK PLC	304,379	13.16	4,005,627.64	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,620	18.47	122,271.40	
BARCLAYS	1,129,529	1.48	1,679,835.52	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,029	6.09	9,057,191.87	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.43	2,080,831.73	

	NATWEST GROUP PLC	426,244	2.32	991,443.54	
	STANDARD CHARTERED PLC	190,159	6.73	1,280,911.02	
	3I GROUP PLC	74,757	18.62	1,392,349.12	
	ABRDN PLC	153,430	2.14	328,493.63	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.79	257,817.72	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,849	80.90	2,414,784.10	
	M&G PLC	131,539	1.84	242,623.68	
	SCHRODERS PLC	39,932	4.20	167,714.40	
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	10.68	437,379.79	
	WISE PLC - A	49,048	6.28	308,413.82	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.29	329,813.95	
	AVIVA PLC	193,334	3.81	738,149.21	
	LEGAL & GENERAL GROUP	408,884	2.20	902,815.87	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.26	268,469.26	
	PRUDENTIAL	212,226	10.39	2,205,028.14	
	SAGE GROUP PLC	76,660	9.00	689,940.00	
	HALMA PLC	31,069	21.53	668,915.57	
	BT GROUP PLC	464,863	1.22	568,295.01	
	VODAFONE GROUP PLC	1,564,850	0.70	1,106,505.43	
	CENTRICA PLC	453,631	1.21	552,749.37	
	NATIONAL GRID PLC	260,089	9.99	2,598,809.28	
	SEVERN TRENT PLC	17,468	23.94	418,183.92	
	SSE PLC	81,692	17.34	1,416,539.28	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	9.31	471,203.28	
イギリスポンド 小計		20,310,344		128,028,462.42 (23,406,163,499)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	13.19	229,479.62	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	670.00	384,580.00	
	GIVAUDAN-REG	678	2,927.00	1,984,506.00	
	HOLCIM LTD	41,204	56.40	2,323,905.60	
	SIG GROUP AG	26,203	24.64	645,641.92	
	SIKA AG-BR	10,856	244.80	2,657,548.80	
	ABB LTD	116,833	33.57	3,922,083.81	
	GEBERIT AG-REG	2,530	444.60	1,124,838.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	194.60	398,540.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	203.00	627,676.00	
	VAT GROUP AG	1,956	356.50	697,314.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	8,571	29.88	256,101.48	
	SGS SA	10,147	81.64	828,401.08	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	261.70	989,487.70	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	38,748	143.80	5,571,962.40	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	264.60	657,001.80	

	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	50.10	197,293.80	
	DUFRY AG-REG	7,820	42.38	331,411.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,663.00	465,640.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	106,000.00	848,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,670.00	874,940.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	204,409	104.66	21,393,445.94	
	ALCON INC	38,399	71.72	2,753,976.28	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	232.50	903,727.50	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	135.95	1,161,013.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	74.15	137,177.50	
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	525.00	2,906,400.00	
	NOVARTIS	152,294	84.91	12,931,283.54	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	283.60	628,174.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	52,222	265.20	13,849,274.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	95.60	237,757.20	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	55.00	840,895.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,574	803.20	1,264,236.80	
	UBS GROUP AG	249,657	17.66	4,410,190.90	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,379	129.70	308,556.30	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	121.40	358,737.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	516.20	1,248,687.80	
	SWISS RE LTD	22,063	88.84	1,960,076.92	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,184	410.50	4,591,032.00	
	TEMENOS AG - REG	5,150	68.58	353,187.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,702	53.20	569,346.40	
	SWISSCOM	1,856	551.20	1,023,027.20	
	BKW AG	1,744	153.30	267,355.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	78.75	447,221.25	
スイスフラン 小計		1,103,720		100,561,133.54 (16,114,921,649)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	22,252	317.55	7,066,122.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	393.80	2,119,825.40	
	SCA SV CELLULOSA B	35,790	140.80	5,039,232.00	
	ALFA LAVAL AB	18,955	373.00	7,070,215.00	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	250.10	19,001,847.70	
	ATLAS COPCO A	207,097	149.40	30,940,291.80	
	ATLAS COPCO B	108,178	130.00	14,063,140.00	
	BEIJER REF AB	26,868	135.50	3,640,614.00	
	EPIROC AB-A	53,479	200.40	10,717,191.60	
	EPIROC AB-B	28,804	172.50	4,968,690.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	94.70	3,666,026.40	
	INDUTRADE AB	22,644	232.80	5,271,523.20	

	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	206.10	2,885,812.20	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	215.60	3,874,332.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	98.00	12,039,104.00	
	SAAB AB-B	6,388	574.40	3,669,267.20	
	SANDVIK AB	75,334	202.70	15,270,201.80	
	SKANSKA B	25,507	155.15	3,957,411.05	
	SKF AB-B	21,050	185.20	3,898,460.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	223.20	3,016,324.80	
	VOLVO B	114,238	217.90	24,892,460.20	
	SECURITAS B	28,375	87.36	2,478,840.00	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	45.32	2,258,703.48	
	EVOLUTION AB	13,186	1,301.60	17,162,897.60	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	24.08	1,279,779.76	
	HENNES & MAURITZ B	41,351	179.16	7,408,445.16	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	279.70	13,837,877.80	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	179.40	3,192,602.40	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	203.40	2,915,739.00	
	NORDEA BANK ABP	236,636	115.70	27,378,785.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	110,001	120.60	13,266,120.60	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	90.82	10,965,243.52	
	SWEDBANK AB-A	58,652	183.60	10,768,507.20	
	EQT AB	31,471	201.80	6,350,847.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	290.90	3,437,856.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	289.80	3,236,486.40	
	INVESTOR AB-A SHS	26,088	206.60	5,389,780.80	
	INVESTOR AB-B SHS	128,538	208.00	26,735,904.00	
	KINNEVIK AB - B	18,792	141.70	2,662,826.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	446.30	3,249,064.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	58.07	12,466,990.23	
	HEXAGON AB-B SHS	148,878	124.80	18,579,974.40	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	89.90	4,203,903.80	
	TELIA CO AB	123,760	24.30	3,007,368.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	42.28	2,397,276.00	
	SAGAX AB-B	17,402	217.20	3,779,714.40	
スウェーデンクローナ 小計		2,691,864		395,479,627.10 (5,208,466,688)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	18,105	261.00	4,725,405.00	
	EQUINOR ASA	73,436	304.90	22,390,636.40	
	NORSK HYDRO	100,517	62.84	6,316,488.28	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	382.20	4,776,735.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	465.00	4,019,925.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	68.00	1,299,956.00	

	MOWI ASA	31,968	168.10	5,373,820.80	
	ORKLA	37,417	76.82	2,874,373.94	
	SALMAR ASA	5,423	426.00	2,310,198.00	
	DNB BANK ASA	71,795	199.10	14,294,384.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	167.00	3,101,858.00	
	TELENOR ASA	51,193	107.85	5,521,165.05	
ノルウェークローネ 小計		448,688		77,004,946.57 (1,032,636,333)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	479.40	4,066,750.20	
	NOVOZYMES A/S	17,111	320.90	5,490,919.90	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,643.50	1,240,842.50	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	72,778	176.90	12,874,428.20	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	12,340.00	2,702,460.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	12,485.00	3,820,410.00	
	DSV A/S	14,203	1,409.50	20,019,128.50	
	PANDORA A/S	7,957	622.40	4,952,436.80	
	CARLSBERG AS-B	6,810	1,041.00	7,089,210.00	
	COLOPLAST-B	9,208	809.60	7,454,796.80	
	DEMANT A/S	8,512	271.40	2,310,156.80	
	GENMAB A/S	4,628	2,571.00	11,898,588.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	123,050	1,074.00	132,155,700.00	
	DANSKE BANK A/S	46,499	165.35	7,688,609.65	
	TRYG A/S	29,772	144.40	4,299,076.80	
	ORSTED A/S	12,910	616.80	7,962,888.00	
デンマーククローネ 小計		363,201		236,026,402.15 (4,951,833,917)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	29.42	606,905.18	
	SANTOS	218,974	7.46	1,633,546.04	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	34.16	4,821,171.60	
	BHP GROUP LTD	377,956	43.20	16,327,699.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	19.51	678,362.70	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	122,505	21.67	2,654,683.35	
	IGO LTD	56,345	15.06	848,555.70	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,156	38.69	1,089,355.64	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	67.45	971,887.05	
	NEWCREST MINING LIMITED	60,966	26.19	1,596,699.54	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	12.23	901,130.86	
	ORICA LTD	38,288	14.67	561,684.96	
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.88	1,022,286.80	
	RIO TINTO LTD	28,272	111.75	3,159,396.00	
	SOUTH32 LTD	346,773	3.67	1,272,656.91	
	REECE LTD	16,814	17.60	295,926.40	

	BRAMBLES LTD	108,007	14.09	1,521,818.63	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	23.22	1,030,410.72	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.87	462,817.17	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.12	520,200.00	
	TRANSURBAN GROUP	224,973	14.00	3,149,622.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	36.80	1,700,528.00	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	21.10	375,432.30	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.10	928,266.30	
	REA GROUP LTD	3,586	139.63	500,713.18	
	SEEK LTD	28,001	22.24	622,742.24	
	WESFARMERS LTD	84,329	47.09	3,971,052.61	
	COLES GROUP LTD	108,486	17.96	1,948,408.56	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.16	676,990.16	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	38.86	3,577,879.06	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	10.78	689,488.80	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	221.56	1,059,721.48	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	55.08	666,853.56	
	SONIC HEALTHCARE LTD	27,240	34.58	941,959.20	
	CSL LIMITED	35,855	266.90	9,569,699.50	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	221,609	23.28	5,159,057.52	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	125,501	98.73	12,390,713.73	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	233,298	25.66	5,986,426.68	
	WESTPAC BANKING	255,840	20.85	5,334,264.00	
	ASX LTD	14,549	60.99	887,343.51	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,105	172.35	4,671,546.75	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	31.02	428,448.24	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.73	954,973.26	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.49	810,318.67	
	QBE INSURANCE GROUP	104,083	15.55	1,618,490.65	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.33	1,264,537.12	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	75.75	1,045,425.75	
	XERO LTD	11,340	115.20	1,306,368.00	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.26	1,314,069.42	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,481	8.43	922,924.83	
オーストラリアドル 小計		5,120,036		116,451,459.53 (11,093,166,034)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	8.38	691,023.18	
	EBOS GROUP LTD	14,283	37.55	536,326.65	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	24.50	979,510.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	97,207	5.02	487,979.14	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.58	425,153.54	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.60	619,046.40	

ニュージーランドドル 小計		409,088		3,739,038.91 (330,493,649)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,496	46.00	8,072,816.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	81.35	8,704,450.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	11.78	1,083,760.00	
	MTR CORP	125,000	35.00	4,375,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	14.64	1,756,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	49.60	8,630,400.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	26.80	5,306,400.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	18.88	2,754,592.00	
	WH GROUP LTD	658,301	3.98	2,620,037.98	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	22.35	6,291,525.00	
	HANG SENG BANK	59,400	106.90	6,349,860.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	282.20	24,918,260.00	
	AIA GROUP LTD	865,600	76.55	66,261,680.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	39.95	1,498,125.00	
	CLP HOLDINGS	102,000	59.20	6,038,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.44	5,825,991.08	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	39.85	4,463,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	42.05	5,129,931.80	
	ESR GROUP LTD	157,000	12.56	1,971,920.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	11.54	1,996,420.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	22.65	2,836,414.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	18.52	2,525,665.00	
	SINO LAND CO	315,400	9.30	2,933,220.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	95.10	9,985,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	10,000	59.85	598,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	18.70	1,798,940.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	38.35	4,717,050.00	
香港ドル 小計		5,609,853		199,444,858.06 (3,631,890,865)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	33.75	270,000.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.45	727,560.00	
	SEATRIUM LTD	2,152,791	0.12	269,098.87	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.57	526,218.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	7.32	792,990.24	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.93	272,304.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.67	655,462.00	
	DBS GROUP	130,200	30.67	3,993,234.00	
	OCBC BANK	257,100	12.05	3,098,055.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	27.40	2,575,600.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.28	612,480.00	

	VENTURE CORP LTD	25,700	14.49	372,393.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	555,643	2.48	1,377,994.64	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	127,200	3.22	409,584.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.76	289,328.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.50	308,750.00	
シンガポールドル 小計		4,346,866		16,551,051.75 (1,751,432,296)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	21.00	1,247,967.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	761.80	1,634,822.80	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	30.75	3,023,032.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	28.02	3,152,586.24	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.23	1,813,885.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	122.80	1,535,368.40	
	NICE LTD	4,991	736.00	3,673,376.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	130.90	1,309,000.00	
	AZRIELI GROUP	1,537	202.20	310,781.40	
イスラエルシェケル 小計		400,926		17,700,819.34 (682,786,094)	
合　計		83,245,041		544,622,314,245 (544,622,314,245)	

(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	83,290	807,913.00	
		LENDLEASE GROUP	64,786	503,387.22	
	オーストラリアドル 小計		148,076	1,311,300.22 (124,914,458)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,907,450.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,907,450.00 (52,944,664)	
投資信託受益証券合計			463,076	177,859,122 (177,859,122)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,462,976.03	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	900,312.70	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	34,641	6,774,047.55	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	719,240.46	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,083	1,926,558.81	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	665,181.72	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	842,936.22	
		CROWN CASTLE INC	32,235	3,724,109.55	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	21,366	2,431,450.80	
	EQUINIX INC	6,951	5,368,326.81	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	928,812.80	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,722,387.90	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,214,066.25	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	9,286	1,375,442.32	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	867,655.25	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	568,480.00	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	930,195.75	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	990,688.85	
	INVITATION HOMES INC	45,008	1,563,577.92	
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,351,741.70	
	KIMCO REALTY CORP	47,897	953,150.30	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,408,398.15	
	PROLOGIS INC	68,641	8,373,515.59	
	PUBLIC STORAGE	11,847	3,401,155.23	
	REALTY INCOME CORP	49,099	2,924,827.43	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	767,049.41	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,567	1,822,511.95	
	SIMON PROPERTY GROUP	23,439	2,778,693.45	
	SUN COMMUNITIES INC	8,423	1,110,235.63	
	UDR INC	23,815	1,015,709.75	
	VENTAS INC	31,565	1,511,963.50	
	VICI PROPERTIES INC	74,643	2,323,636.59	
	WELLTOWER INC	36,855	2,941,397.55	
	WP CAREY INC	16,024	1,084,023.60	
アメリカドル 小計		894,017	68,744,457.52 (9,798,834,974)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	242,835.03	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	295,394.30	
カナダドル 小計		20,377	538,229.33 (57,752,007)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	217,434.84	
	GECINA SA	3,139	296,635.50	
	KLEPIERRE	17,225	385,667.75	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	517,627.05	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	341,446.16	
ユーロ 小計		48,695	1,758,811.30 (274,902,206)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	240,624.42	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	322,085.65	
	SEGRO PLC	78,133	554,431.76	

	イギリスポンド 小計		213,836	1,117,141.83 (204,235,869)	
	オーストラリアドル	DEXUS	94,090	736,724.70	
		GOODMAN GROUP	116,335	2,282,492.70	
		GPT GROUP	167,884	683,287.88	
		MIRVAC GROUP	266,683	597,369.92	
		SCENTRE GROUP	381,283	995,148.63	
		STOCKLAND	207,412	819,277.40	
		VICINITY CENTERS	305,149	550,793.94	
	オーストラリアドル 小計		1,538,836	6,665,095.17 (634,916,965)	
	香港ドル	LINK REIT	166,900	7,001,455.00	
	香港ドル 小計		166,900	7,001,455.00 (127,496,495)	
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	758,648.46	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	629,663.94	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	455,934.29	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	349,800.00	
	シンガポールドル 小計		1,125,856	2,194,046.69 (232,174,020)	
投資証券合計			4,008,517	11,330,312,536 (11,330,312,536)	
合計				11,508,171,658 (11,508,171,658)	

(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　606銘柄	97.6%	—	—	72.6%
	投資証券　34銘柄	—	—	2.4%	1.8%
カナダドル	株式　85銘柄	99.7%	—	—	3.4%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式　223銘柄	99.5%	—	—	9.7%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式　79銘柄	99.1%	—	—	4.2%

	投資証券　3銘柄	—	—	0.9%	0.0%
スイスフラン	株式　44銘柄	100.0%	—	—	2.9%
スウェーデンクローナ	株式　46銘柄	100.0%	—	—	0.9%
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	93.6%	—	—	2.0%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	1.1%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	5.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　6銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　27銘柄	95.3%	—	—	0.7%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	1.4%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.3%	0.0%
シンガポールドル	株式　16銘柄	88.3%	—	—	0.3%
	投資証券　4銘柄	—	—	11.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	210,081,799
コール・ローン	10,499,196
株式	10,634,189,297
投資信託受益証券	5,872,621
投資証券	230,324,184
派生商品評価勘定	9,334,006
未収入金	740,671,915
未収配当金	10,087,010
差入委託証拠金	110,796,243
流動資産合計	11,961,856,271
資産合計	11,961,856,271

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,476,030
前受金	839,409
未払解約金	800,001,218
未払利息	8
流動負債合計	802,316,665
負債合計	802,316,665
純資産の部	
元本等	
元本	8,493,667,478
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,665,872,128
元本等合計	11,159,539,606
純資産合計	11,159,539,606
負債純資産合計	11,961,856,271

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10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 7月10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 7月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	8,493,667,478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 1.3139円 (1万口当たり純資産額) (13,139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 7月10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 7月10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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	1,568,393,019円
期中追加設定元本額	7,731,799,661円
期中一部解約元本額	806,525,202円
期末元本額	8,493,667,478円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	148,840,675円
コア投資戦略ファンド（成長型）	368,868,172円
コア投資戦略ファンド（切替型）	185,653,993円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	96,694,266円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	5,374,238,657円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	155,144,883円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,192,199円
ＤＣ外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスファンド	2,062,057,095円
ＦＯＦｓ用　外国株式ＥＳＧリーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	67,977,538円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	52,110,274
投資信託受益証券	78,288
投資証券	10,051,592

合計	62,240,154

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式ＥＳＧリーダーズ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 7月10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	273,622,953	－	274,462,362	839,409
合計		273,622,953	－	274,462,362	839,409

(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10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,029,829	－	4,030,051	222
	カナダドル	2,467,118	－	2,467,216	98
	ユーロ	1,562,711	－	1,562,835	124
	売建	792,947,026	－	785,928,681	7,018,345
	アメリカドル	590,646,000	－	584,324,210	6,321,790
	カナダドル	28,008,500	－	27,894,152	114,348
	ユーロ	73,700,230	－	73,453,245	246,985
	イギリスポンド	33,373,886	－	33,268,307	105,579
	スイスフラン	17,676,010	－	17,626,543	49,467
	スウェーデンクローナ	6,421,104	－	6,426,325	△5,221
	ノルウェークローネ	2,258,178	－	2,266,019	△7,841
	デンマーククローネ	11,639,544	－	11,600,889	38,655
	オーストラリアドル	11,255,076	－	11,239,346	15,730

	ニュージーランドドル	4,433,400	—	4,418,790	14,610
	香港ドル	8,212,198	—	8,120,500	91,698
	シンガポールドル	5,322,900	—	5,290,355	32,545
合計		796,976,855	—	789,958,732	7,018,567

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数（株）	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	2,759	33.11	91,350.49	
	CHENIERE ENERGY INC	665	152.19	101,206.35	
	HALLIBURTON CO	2,609	35.58	92,828.22	
	HF SINCLAIR CORP	505	45.76	23,108.80	
	KINDER MORGAN INC	5,833	16.92	98,694.36	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,274	118.02	150,357.48	
	ONEOK INC	1,294	62.17	80,447.98	
	PHILLIPS 66	1,384	99.44	137,624.96	
	SCHLUMBERGER	4,119	53.35	219,748.65	
	TARGA RESOURCES CORP	634	77.30	49,008.20	
	VALERO ENERGY CORP	1,048	114.88	120,394.24	
	WILLIAMS COS	3,424	32.73	112,067.52	
	AMCOR PLC	4,384	9.94	43,576.96	
	AVERY DENNISON CORP	251	171.65	43,084.15	
	BALL CORP	934	57.46	53,667.64	
	ECOLAB INC	732	183.40	134,248.80	
	INT'L PAPER CO	1,067	31.80	33,930.60	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	738	78.59	57,999.42	
	LINDE PLC	1,414	364.51	515,417.14	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	692	90.50	62,626.00	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	181	440.17	79,670.77	
	NEWMONT CORPORATION	2,199	42.24	92,885.76	
	NUCOR CORP	768	161.95	124,377.60	

PPG INDUSTRIES INC	679	146.77	99,656.83	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	695	255.42	177,516.90	
STEEL DYNAMICS INC	419	105.16	44,062.04	
WESTROCK CO	968	29.00	28,072.00	
3 M COMPANY	1,647	97.29	160,236.63	
AECOM	408	85.81	35,010.48	
ALLEGION PLC	283	116.79	33,051.57	
AXON ENTERPRISE INC	214	188.10	40,253.40	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	427	133.10	56,833.70	
CARRIER GLOBAL CORP	2,450	49.33	120,858.50	
CATERPILLAR	1,489	245.18	365,073.02	
CUMMINS INC	392	245.80	96,353.60	
DOVER CORP	420	146.10	61,362.00	
EATON CORP	1,148	198.46	227,832.08	
EMERSON ELECTRIC CO	1,606	88.94	142,837.64	
FASTENAL CO	1,665	57.87	96,353.55	
FERGUSON PLC	634	154.79	98,136.86	
FORTIVE CORP	1,007	72.35	72,856.45	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	438	69.08	30,257.04	
GENERAC HOLDINGS INC	175	136.08	23,814.00	
GRACO INC	519	83.57	43,372.83	
GRAINGER (WW) INC	133	776.18	103,231.94	
IDEX CORP	222	209.98	46,615.56	
ILLINOIS TOOL WORKS	879	243.81	214,308.99	
INGERSOLL-RAND INC	1,181	64.26	75,891.06	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,930	66.90	129,117.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	513	194.66	99,860.58	
LENNOX INTERNATIONAL INC	108	320.08	34,568.64	
MASCO CORP	695	55.21	38,370.95	
OTIS WORLDWIDE CORP	1,222	86.86	106,142.92	
OWENS CORNING	238	127.13	30,256.94	
PENTAIR PLC	473	62.84	29,723.32	
QUANTA SERVICES INC	418	193.60	80,924.80	
ROCKWELL AUTOMATION INC	336	325.38	109,327.68	
TORO CO	322	101.16	32,573.52	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	674	189.19	127,514.06	
UNITED RENTALS INC	208	433.57	90,182.56	
XYLEM INC	724	109.57	79,328.68	
AUTOMATIC DATA PROCESS	1,168	218.74	255,488.32	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	364	163.30	59,441.20	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	453	65.60	29,716.80	
CINTAS CORP	253	480.24	121,500.72	

CLARIVATE PLC	1,200	9.30	11,160.00	
PAYCHEX INC	872	113.44	98,919.68	
PAYLOCITY HOLDING CORP	129	187.13	24,139.77	
ROBERT HALF INTL INC	369	77.53	28,608.57	
TRANSUNION	597	76.48	45,658.56	
WASTE MANAGEMENT INC	1,158	170.01	196,871.58	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	374	95.26	35,627.24	
CSX CORP	5,817	33.30	193,706.10	
DELTA AIR LINES INC	457	47.88	21,881.16	
EXPEDITORS INTL WASH INC	440	118.90	52,316.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	245	179.61	44,004.45	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	528	54.74	28,902.72	
NORFOLK SOUTHERN CORP	635	226.72	143,967.20	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	286	369.94	105,802.84	
UNION PACIFIC CORP	1,760	202.82	356,963.20	
UNITED PARCEL SERVICE B	2,085	179.76	374,799.60	
APTIV PLC	782	107.55	84,104.10	
BORGWARNER INC	783	44.95	35,195.85	
LEAR CORP	205	148.63	30,469.15	
PHINIA INC	156	33.25	5,187.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1,859	24.70	45,917.30	
TESLA INC	8,239	274.43	2,261,028.77	
DECKERS OUTDOOR CORP	81	527.18	42,701.58	
HASBRO INC	452	64.56	29,181.12	
LULULEMON ATHLETICA INC	328	363.74	119,306.72	
NIKE B	3,523	104.46	368,012.58	
NVR INC	10	6,062.78	60,627.80	
PULTE GROUP INC	693	75.03	51,995.79	
VF CORP	952	18.66	17,764.32	
WHIRLPOOL CORP	169	148.28	25,059.32	
ARAMARK	725	42.38	30,725.50	
BOOKING HOLDINGS INC	108	2,636.91	284,786.28	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	802	148.32	118,952.64	
MCDONALD'S CORP	2,105	292.10	614,870.50	
VAIL RESORTS INC	114	243.90	27,804.60	
YUM BRANDS INC	806	133.45	107,560.70	
ALPHABET INC-CL A	17,234	119.48	2,059,118.32	
ALPHABET INC-CL C	15,531	120.14	1,865,894.34	
COMCAST CORP-CL A	12,155	41.43	503,581.65	
ELECTRONIC ARTS INC	807	129.20	104,264.40	
FOX CORP - CLASS A	918	34.08	31,285.44	
FOX CORP- CLASS B	492	31.92	15,704.64	

INTERPUBLIC GROUP OF COS	1,160	37.94	44,010.40	
OMNICOM GROUP	623	92.99	57,932.77	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,923	4.45	8,557.35	
SNAP INC - A	3,077	11.68	35,939.36	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	471	143.19	67,442.49	
THE WALT DISNEY CO	5,298	88.64	469,614.72	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	772	25.52	19,701.44	
ADVANCE AUTO PARTS	179	69.38	12,419.02	
AUTOZONE INC	52	2,469.51	128,414.52	
BEST BUY COMPANY INC	593	79.30	47,024.90	
BURLINGTON STORES INC	211	154.12	32,519.32	
CARMAX INC	544	81.39	44,276.16	
EBAY	1,625	44.26	71,922.50	
GENUINE PARTS CO	410	165.42	67,822.20	
HOME DEPOT	2,920	302.81	884,205.20	
LKQ CORP	787	57.19	45,008.53	
LOWES COMPANIES	1,719	221.94	381,514.86	
MERCADOLIBRE INC	127	1,153.82	146,535.14	
POOL CORP	117	365.72	42,789.24	
TJX COMPANIES INC	3,310	82.70	273,737.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	324	216.86	70,262.64	
ULTA BEAUTY INC	150	471.63	70,744.50	
KROGER CO	1,998	47.17	94,245.66	
TARGET (DAYTON HUDSON)	1,287	130.05	167,374.35	
BUNGE LIMITED	445	100.99	44,940.55	
CAMPBELL SOUP CO (US)	623	45.54	28,371.42	
COCA-COLA CO	11,807	59.76	705,586.32	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	480	64.49	30,955.20	
CONAGRA BRANDS INC	1,400	33.22	46,508.00	
DARLING INGREDIENTS INC	500	62.86	31,430.00	
GENERAL MILLS INC	1,594	75.17	119,820.98	
HORMEL FOODS CORP	878	39.35	34,549.30	
JM SMUCKER CO	330	147.71	48,744.30	
KELLOGG CO	728	67.19	48,914.32	
KEURIG DR PEPPER INC	2,826	31.76	89,753.76	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	450	112.62	50,679.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	728	84.67	61,639.76	
PEPSICO INC	3,958	183.08	724,630.64	
CHURCH & DWIGHT CO INC	755	98.97	74,722.35	
CLOROX COMPANY	359	157.99	56,718.41	
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,237	75.59	169,094.83	
KIMBERLY-CLARK CORP	939	135.36	127,103.04	

PROCTER & GAMBLE CO	6,797	148.80	1,011,393.60	
ALIGN TECHNOLOGY INC	218	329.54	71,839.72	
AMERISOURCEBERGEN CORP	487	190.86	92,948.82	
DAVITA INC	138	103.89	14,336.82	
DENTSPLY SIRONA INC	579	38.83	22,482.57	
DEXCOM INC	1,118	126.71	141,661.78	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,748	90.26	157,774.48	
ELEVANCE HEALTH INC	684	429.40	293,709.60	
HCA HEALTHCARE INC	597	291.49	174,019.53	
HOLOGIC INC	728	77.51	56,427.28	
HUMANA INC	358	430.14	153,990.12	
IDEXX LABORATORIES INC	240	498.01	119,522.40	
INSULET CORP	202	278.67	56,291.34	
LABORATORY CRP OF AMER	269	208.28	56,027.32	
MOLINA HEALTHCARE INC	179	295.23	52,846.17	
QUEST DIAGNOSTICS	343	139.00	47,677.00	
STERIS PLC	292	217.85	63,612.20	
TELEFLEX INC	130	235.92	30,669.60	
THE CIGNA GROUP	857	277.12	237,491.84	
THE COOPER COS INC	150	378.38	56,757.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	599	140.86	84,375.14	
AGILENT TECHNOLOGIES	848	117.00	99,216.00	
AMGEN	1,540	218.65	336,721.00	
AVANTOR INC	2,087	20.73	43,263.51	
BIO-TECHNE CORP	460	80.80	37,168.00	
BIOGEN INC	416	275.07	114,429.12	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6,063	62.65	379,846.95	
DANAHER CORP	1,997	233.08	465,460.76	
ELI LILLY & CO	2,329	452.08	1,052,894.32	
GILEAD SCIENCES INC	3,600	74.42	267,912.00	
ILLUMINA INC	483	183.32	88,543.56	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	201	122.00	24,522.00	
JOHNSON & JOHNSON	7,493	159.25	1,193,260.25	
MERCK & CO	7,316	109.00	797,444.00	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	65	1,269.09	82,490.85	
REPLIGEN CORP	163	141.54	23,071.02	
WATERS CORP	175	264.15	46,226.25	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	215	371.60	79,894.00	
ZOETIS INC	1,318	167.14	220,290.52	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,443	26.93	38,859.99	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,183	10.89	45,552.87	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,187	125.61	149,099.07	

REGIONS FINL CORP	2,716	18.33	49,784.28	
TRUIST FINANCIAL CORP	3,591	31.88	114,481.08	
US BANCORP	4,320	33.54	144,892.80	
WEBSTER FINANCIAL CORP	434	38.86	16,865.24	
ALLY FINANCIAL INC	530	26.63	14,113.90	
AMERICAN EXPRESS	1,824	169.80	309,715.20	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	317	332.62	105,440.54	
BANK NEW YORK CO	2,240	44.38	99,411.20	
BLACKROCK INC	433	684.10	296,215.30	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	324	135.84	44,012.16	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	779	116.94	91,096.26	
EQUITABLE HOLDINGS INC	1,127	27.23	30,688.21	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	114	387.57	44,182.98	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	1,579	59.27	93,587.33	
FISERV INC	1,797	125.20	224,984.40	
FRANKLIN RESOURCES INC	1,031	26.15	26,960.65	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,581	112.29	177,530.49	
INVESCO LTD	833	16.92	14,094.36	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	232	224.82	52,158.24	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	116	248.10	28,779.60	
MASTERCARD INC-CLASS A	2,454	388.68	953,820.72	
MOODY'S CORP	461	339.57	156,541.77	
MORGAN STANLEY	3,616	83.36	301,429.76	
NASDAQ INC	1,005	48.97	49,214.85	
NORTHERN TRUST CORP	577	74.32	42,882.64	
PRICE T ROWE GROUP INC	659	110.23	72,641.57	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	554	104.33	57,798.82	
S&P GLOBAL INC	946	393.25	372,014.50	
SCHWAB (CHARLES) CORP	4,332	56.79	246,014.28	
STATE STREET CORP	867	73.88	64,053.96	
SYNCHRONY FINANCIAL	1,038	33.61	34,887.18	
VISA INC-CLASS A SHARES	4,685	236.45	1,107,768.25	
AFLAC	1,664	70.04	116,546.56	
ALLSTATE CORP	792	108.27	85,749.84	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,094	74.79	81,820.26	
ASSURANT INC	131	125.86	16,487.66	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	954	72.73	69,384.42	
MARSH & MCLENNAN COS	1,428	183.99	262,737.72	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	734	76.62	56,239.08	
PROGRESSIVE CORP	1,688	131.26	221,566.88	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,081	89.85	97,127.85	
TRAVELERS COS INC/THE	691	171.65	118,610.15	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	323	230.84	74,561.32	
WEYERHAEUSER CO	2,160	33.45	72,252.00	
ACCENTURE PLC-CL A	1,821	305.76	556,788.96	
ADOBE INC	1,323	485.27	642,012.21	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	483	89.77	43,358.91	
ANSYS INC	253	320.17	81,003.01	
AUTODESK INC	626	201.57	126,182.82	
BLACK KNIGHT INC	485	60.26	29,226.10	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	788	226.89	178,789.32	
DOCUSIGN INC	624	49.70	31,012.80	
FAIR ISAAC CORP	78	793.79	61,915.62	
GARTNER INC	244	347.74	84,848.56	
GEN DIGITAL INC	1,758	18.08	31,784.64	
HUBSPOT INC	133	512.86	68,210.38	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,615	132.08	345,389.20	
INTUIT INC	809	448.19	362,585.71	
MICROSOFT CORP	20,453	337.22	6,897,160.66	
PTC INC	347	137.25	47,625.75	
SALESFORCE INC	2,883	209.59	604,247.97	
SERVICENOW INC	579	552.98	320,175.42	
SPLUNK INC	491	104.41	51,265.31	
SYNOPSYS INC	438	431.29	188,905.02	
TWILIO INC - A	549	62.45	34,285.05	
VMWARE INC-CLASS A	628	141.40	88,799.20	
WORKDAY INC-CLASS A	581	218.73	127,082.13	
ZSCALER INC	269	143.18	38,515.42	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,794	16.87	64,004.78	
HP INC	2,548	31.13	79,319.24	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	526	163.77	86,143.02	
NETAPP INC	661	76.25	50,401.25	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	575	60.28	34,661.00	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	733	52.07	38,167.31	
WESTERN DIGITAL CORP	987	37.67	37,180.29	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	550	17.80	9,790.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	799	18.74	14,973.26	
VERIZON COMMUNICATIONS	12,107	35.90	434,641.30	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	526	141.06	74,197.56	
ATMOS ENERGY CORP	407	117.31	47,745.17	
CMS ENERGY CORP	902	59.30	53,488.60	
CONSOLIDATED EDISON INC	1,023	92.03	94,146.69	
EDISON INTL	1,106	68.86	76,159.16	
ESSENTIAL UTILITIES INC	767	39.15	30,028.05	

	EVERSOURCE ENERGY	986	70.83	69,838.38	
	EXELON CORP	2,743	40.96	112,353.28	
	SEMPRA ENERGY	904	144.13	130,293.52	
	UGI CORP	712	25.95	18,476.40	
	APPLIED MATERIALS	2,437	139.57	340,132.09	
	INTEL CORP	12,024	31.85	382,964.40	
	LAM RESEARCH CORP	389	617.87	240,351.43	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	2,410	59.15	142,551.50	
	NVIDIA CORP	7,146	425.03	3,037,264.38	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	749	204.06	152,840.94	
	TEXAS INSTRUMENTS	2,616	173.70	454,399.20	
	CBRE GROUP INC-A	948	81.87	77,612.76	
アメリカドル 小計		438,280		55,667,276.74 (7,934,813,626)	
カナダドル	CAMECO CORP	1,280	39.34	50,355.20	
	ENBRIDGE	5,819	48.38	281,523.22	
	KEYERA CORP	573	30.66	17,568.18	
	PARKLAND CORP	413	33.00	13,629.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,603	40.50	64,921.50	
	AGNICO EAGLE MINES	1,291	64.26	82,959.66	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,594	12.33	19,654.02	
	KINROSS GOLD CORP	3,375	6.10	20,587.50	
	LUNDIN MINING CORP	1,764	10.74	18,945.36	
	NUTRIEN LTD	1,537	80.86	124,281.82	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	74	112.27	8,307.98	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,322	55.21	72,987.62	
	CAE INC	1,167	28.86	33,679.62	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	133	108.65	14,450.45	
	RB GLOBAL INC	570	78.26	44,608.20	
	THOMSON REUTERS CORP	478	172.36	82,388.08	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,626	153.52	249,623.52	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	820	77.25	63,345.00	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	546	42.50	23,205.00	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	143	181.87	26,007.41	
	DOLLARAMA INC	810	87.10	70,551.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,390	65.26	155,971.40	
	METRO INC	705	73.09	51,528.45	
	BANK MONTREAL	2,046	119.15	243,780.90	
	BANK NOVA SCOTIA	3,337	63.95	213,401.15	
	NATIONAL BANK OF CANADA	976	98.21	95,852.96	
	TORONTO-DOMINION BANK	5,252	80.88	424,781.76	
	BROOKFIELD CORP	3,925	43.29	169,913.25	

	INTACT FINANCIAL CORP	509	199.30	101,443.70	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,814	67.63	122,680.82	
	OPEN TEXT CORP	684	52.57	35,957.88	
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,451	81.90	282,636.90	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,039	60.20	62,547.80	
	TELUS CORP	1,700	25.76	43,792.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	2,113	10.47	22,123.11	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	407	41.45	16,870.15	
	FORTIS INC	1,389	55.98	77,756.22	
	HYDRO ONE LTD	1,129	37.11	41,897.19	
	FIRSTSERVICE CORP	103	203.15	20,924.45	
カナダドル 小計		59,907		3,567,439.43 (382,786,250)	
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,436	10.80	15,508.80	
	NESTE OIL OYJ	1,231	35.65	43,885.15	
	OMV AG	448	40.03	17,933.44	
	REPSOL SA	4,227	12.74	53,873.11	
	TENARIS SA	1,751	13.63	23,874.88	
	TOTALENERGIES SE	6,880	51.10	351,568.00	
	AKZO NOBEL	535	72.16	38,605.60	
	COVESTRO AG	600	47.87	28,722.00	
	CRH PLC	2,209	49.01	108,263.09	
	DSM-FIRMENICH AG	507	99.21	50,299.47	
	EVONIK INDUSTRIES AG	657	17.73	11,651.89	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	377	68.08	25,666.16	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	816	31.08	25,361.28	
	STORA ENSO OYJ R	2,074	10.85	22,513.27	
	SYMRISE AG	390	93.50	36,465.00	
	UMICORE	562	25.71	14,449.02	
	UPM KYMMENE OYJ	1,554	27.70	43,045.80	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	722	29.42	21,241.24	
	ACS ACTIVIDADES DE CO-RIGHTS	722	1.46	1,057.36	
	BOUYGUES ORD	586	29.37	17,210.82	
	BRENNTAG SE	390	68.98	26,902.20	
	CNH INDUSTRIAL NV	3,006	13.08	39,333.51	
	EIFFAGE	151	92.76	14,006.76	
	GEA GROUP AG	399	36.63	14,615.37	
	KINGSPAN GROUP PLC	415	57.04	23,671.60	
	KNORR-BREMSE AG	224	64.36	14,416.64	
	METSO CORPORATION	2,196	10.96	24,079.14	
	PRYSMIAN SPA	664	36.84	24,461.76	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,564	156.92	245,422.88	

WARTSILA OYJ	1,323	9.91	13,121.51	
TELEPERFORMANCE	171	145.00	24,795.00	
WOLTERS KLUWER	760	109.60	83,296.00	
ADP	92	128.00	11,776.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	2,000	9.01	18,034.00	
DHL GROUP	2,815	43.96	123,747.40	
GETLINK	1,366	15.73	21,494.01	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	967	107.14	103,604.38	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	160	99.75	15,960.00	
MICHELIN	1,982	26.36	52,245.52	
VALEO SA	653	19.55	12,766.15	
ADIDAS AG	442	166.62	73,646.04	
HERMES INTERNATIONAL	92	1,862.20	171,322.40	
KERING	207	477.60	98,863.20	
LVMH	796	825.40	657,018.40	
MONCLER SPA	637	61.60	39,239.20	
PUMA SE	276	51.94	14,335.44	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	1,243	65.76	81,739.68	
JUST EAT TAKEAWAY	584	13.44	7,852.46	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	2,019	20.70	41,793.30	
PROSUS	2,189	64.20	140,533.80	
ZALANDO SE	648	24.69	15,999.12	
CARREFOUR	2,101	16.88	35,475.38	
HELLOFRESH SE	519	24.50	12,715.50	
JERONIMO MARTINS	863	25.48	21,989.24	
KESKO OYJ-B SHS	689	17.39	11,985.15	
KONINKLIJKE AHOLD NV	3,024	31.21	94,379.04	
DANONE (GROUPE)	1,817	55.26	100,407.42	
JDE PEET'S BV	322	27.00	8,694.00	
KERRY GROUP PLC-A	466	88.58	41,278.28	
BEIERSDORF AG	244	116.50	28,426.00	
HENKEL AG & CO KGAA	380	61.86	23,506.80	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	525	70.26	36,886.50	
LOREAL	695	402.65	279,841.75	
MERCK KGAA	375	146.50	54,937.50	
BNP PARIBAS	3,102	55.12	170,982.24	
COMMERZBANK AG	2,731	10.30	28,129.30	
CREDIT AGRICOLE SA	3,742	10.59	39,635.26	
FINECOBANK SPA	1,888	12.85	24,260.80	
ING GROEP NV-CVA	10,509	12.37	130,080.40	
KBC GROEP NV	629	64.42	40,520.18	
MEDIOBANCA	1,829	11.01	20,137.29	

	SOCIETE GENERALE	2,317	23.30	53,997.68	
	DEUTSCHE BOERSE	548	161.20	88,337.60	
	NEXI SPA	1,449	7.59	11,000.80	
	WORLDLINE SA	855	34.18	29,223.90	
	ASSICURAZIONI GENERALI	2,883	18.44	53,176.93	
	AXA SA	5,255	25.35	133,214.25	
	MUENCHENER RUECKVERSICH.	394	327.90	129,192.60	
	NN GROUP NV	822	33.28	27,356.16	
	POSTE ITALIANE SPA	1,615	9.77	15,781.78	
	DASSAULT SYSTEMES SA	2,064	39.06	80,619.84	
	NOKIA OYJ	16,542	3.82	63,240.06	
	ELISA A	335	47.71	15,982.85	
	KPN (KON.)	9,816	3.23	31,744.94	
	ORANGE	4,544	10.33	46,948.60	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	3,486	2.38	8,303.65	
	ENEL	23,324	6.09	142,206.42	
	IBERDROLA SA	16,800	11.18	187,908.00	
	IBERDROLA SA-RTS	16,800	0.29	5,009.76	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	460	26.00	11,960.00	
	REDEIA CORP SA	1,048	14.87	15,589.00	
	TERNA SPA	4,688	7.46	34,991.23	
	VERBUND AG	197	71.20	14,026.40	
	ASML HOLDING NV	1,166	640.40	746,706.40	
	STMICROELECTRONICS NV	1,818	43.80	79,628.40	
	LEG IMMOBILIEN SE	314	53.50	16,799.00	
	VONOVIA SE	2,300	17.78	40,905.50	
ユーロ 小計		217,005		6,489,408.03 (1,014,294,475)	
イギリスポンド	ANGLO AMERICAN PLC	3,435	22.01	75,604.35	
	ANTOFAGASTA PLC	1,001	14.15	14,169.15	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	412	55.62	22,915.44	
	ENDEAVOUR MINING PLC	600	18.30	10,980.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	471	17.07	8,039.97	
	MONDI PLC	1,612	12.14	19,577.74	
	ASHTEAD GROUP PLC	1,285	50.94	65,457.90	
	DCC PLC	249	42.03	10,465.47	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	247	99.74	24,635.78	
	INTERTEK GROUP PLC	354	39.98	14,152.92	
	RELX PLC	5,492	24.63	135,267.96	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,612	4.02	10,518.52	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	284	38.72	10,996.48	
	BURBERRY GROUP PLC	1,289	20.33	26,205.37	

	TAYLOR WIMPEY PLC	9,184	1.00	9,225.32	
	AUTO TRADER GROUP PLC	2,840	5.97	16,966.16	
	INFORMA PLC	4,350	7.05	30,702.30	
	WPP PLC	3,240	8.14	26,380.08	
	KINGFISHER PLC	5,110	2.24	11,451.51	
	OCADO GROUP PLC	1,843	5.92	10,910.56	
	SAINSBURY (J) PLC	4,524	2.70	12,237.42	
	TESCO PLC	22,008	2.46	54,227.71	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,302	19.91	25,929.33	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	468	23.72	11,100.96	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,972	57.42	113,232.24	
	UNILEVER PLC	7,398	39.90	295,217.19	
	ASTRAZENECA	4,468	101.10	451,714.80	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	57,721	6.09	352,040.37	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	174,709	0.43	75,290.84	
	3I GROUP PLC	3,009	18.62	56,042.62	
	ABRDN PLC	6,887	2.14	14,745.06	
	SCHRODERS PLC	2,334	4.20	9,802.80	
	ST JAMES'S PLACE PLC	1,915	10.68	20,461.77	
	ADMIRAL GROUP PLC	656	20.29	13,310.24	
	LEGAL & GENERAL GROUP	17,456	2.20	38,542.84	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	2,320	5.26	12,212.48	
	PRUDENTIAL	7,629	10.39	79,265.31	
	SAGE GROUP PLC	3,200	9.00	28,800.00	
	BT GROUP PLC	20,577	1.22	25,155.38	
	VODAFONE GROUP PLC	61,547	0.70	43,519.88	
	NATIONAL GRID PLC	10,292	9.99	102,837.66	
イギリスポンド 小計		458,302		2,390,309.88 (436,996,452)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	589	13.19	7,768.91	
	GIVAUDAN-REG	28	2,927.00	81,956.00	
	SIG GROUP AG	1,000	24.64	24,640.00	
	SIKA AG-BR	389	244.80	95,227.20	
	ABB LTD	4,346	33.57	145,895.22	
	GEBERIT AG-REG	104	444.60	46,238.40	
	VAT GROUP AG	83	356.50	29,589.50	
	SGS SA	475	81.64	38,779.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	160	261.70	41,872.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	6	10,670.00	64,020.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	157	232.50	36,502.50	
	LONZA GROUP AG-REG	199	525.00	104,475.00	
	NOVARTIS	5,837	84.91	495,619.67	

	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	144	95.60	13,766.40	
	JULIUS BAER GROUP LTD	700	55.00	38,500.00	
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	129.70	20,752.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	92	516.20	47,490.40	
	SWISS RE LTD	935	88.84	83,065.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	421	410.50	172,820.50	
	TEMENOS AG - REG	200	68.58	13,716.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	508	53.20	27,025.60	
	SWISSCOM	80	551.20	44,096.00	
スイスフラン 小計		16,613		1,673,815.70 (268,228,965)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	963	317.55	305,800.65	
	HOLMEN AB-B SHARES	294	393.80	115,777.20	
	SCA SV CELLULOSA B	1,564	140.80	220,211.20	
	ALFA LAVAL AB	655	373.00	244,315.00	
	ASSA ABLOY AB-B	2,915	250.10	729,041.50	
	ATLAS COPCO A	7,323	149.40	1,094,056.20	
	ATLAS COPCO B	4,574	130.00	594,620.00	
	BEIJER REF AB	1,031	135.50	139,700.50	
	EPIROC AB-A	1,948	200.40	390,379.20	
	EPIROC AB-B	1,045	172.50	180,262.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,379	94.70	130,591.30	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,447	98.00	435,806.00	
	SANDVIK AB	3,113	202.70	631,005.10	
	SKF AB-B	1,022	185.20	189,274.40	
	HENNES & MAURITZ B	1,899	179.16	340,224.84	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,790	279.70	500,663.00	
	NORDEA BANK ABP	9,852	115.70	1,139,876.40	
	SVENSKA HANDELSBK A	4,600	90.82	417,772.00	
	EQT AB	1,233	201.80	248,819.40	
	KINNEVIK AB - B	912	141.70	129,230.40	
	TELE2 AB-B SHS	1,519	89.90	136,558.10	
	TELIA CO AB	7,952	24.30	193,233.60	
スウェーデンクローナ 小計		62,030		8,507,218.49 (112,040,067)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	887	261.00	231,507.00	
	EQUINOR ASA	2,821	304.90	860,122.90	
	NORSK HYDRO	4,021	62.84	252,679.64	
	MOWI ASA	1,166	168.10	196,004.60	
	ORKLA	2,110	76.82	162,090.20	
	SALMAR ASA	202	426.00	86,052.00	
	DNB BANK ASA	2,716	199.10	540,755.60	

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	604	167.00	100,868.00	
	TELENOR ASA	2,114	107.85	227,994.90	
ノルウェークローネ 小計		16,641		2,658,074.84 (35,644,783)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	277	479.40	132,793.80	
	NOVOZYMES A/S	604	320.90	193,823.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	50	1,643.50	82,175.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	2,937	176.90	519,555.30	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	8	12,340.00	98,720.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	18	12,485.00	224,730.00	
	DSV A/S	511	1,409.50	720,254.50	
	PANDORA A/S	241	622.40	149,998.40	
	COLOPLAST-B	348	809.60	281,740.80	
	GENMAB A/S	172	2,571.00	442,212.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	4,790	1,074.00	5,144,460.00	
	ORSTED A/S	553	616.80	341,090.40	
デンマーククローネ 小計		10,509		8,331,553.80 (174,795,998)	
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,325	34.16	181,902.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,217	19.51	23,743.67	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	4,932	21.67	106,876.44	
	IGO LTD	2,596	15.06	39,095.76	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,323	38.69	51,186.87	
	MINERAL RESOURCES LTD	565	67.45	38,109.25	
	NEWCREST MINING LIMITED	2,644	26.19	69,246.36	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	4,039	12.23	49,396.97	
	ORICA LTD	1,151	14.67	16,885.17	
	PILBARA MINERALS LTD	9,000	4.88	43,920.00	
	BRAMBLES LTD	4,243	14.09	59,783.87	
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,618	23.22	37,569.96	
	AURIZON HOLDINGS LTD	4,697	3.87	18,177.39	
	TRANSURBAN GROUP	8,838	14.00	123,732.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,768	36.80	65,062.40	
	IDP EDUCATION LTD	654	21.10	13,799.40	
	REA GROUP LTD	82	139.63	11,449.66	
	SEEK LTD	857	22.24	19,059.68	
	COLES GROUP LTD	3,916	17.96	70,331.36	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	3,373	6.16	20,777.68	
	COCHLEAR LIMITED	213	221.56	47,192.28	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	705	55.08	38,831.40	
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,432	34.58	49,518.56	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	8,336	23.28	194,062.08	

	ASX LTD	680	60.99	41,473.20	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	1,015	172.35	174,935.25	
	QBE INSURANCE GROUP	4,375	15.55	68,031.25	
	SUNCORP GROUP LIMITED	4,460	13.33	59,451.80	
	XERO LTD	322	115.20	37,094.40	
	TELSTRA GROUP LTD	12,031	4.26	51,252.06	
オーストラリアドル 小計		96,407		1,821,948.17 (173,558,782)	
ニュージーランドドル	EBOS GROUP LTD	527	37.55	19,788.85	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	5,704	5.02	28,634.08	
	MERCURY NZ LTD	2,339	6.58	15,390.62	
	MERIDIAN ENERGY LTD	4,004	5.60	22,422.40	
ニュージーランドドル 小計		12,574		86,235.95 (7,622,395)	
香港ドル	MTR CORP	4,000	35.00	140,000.00	
	WH GROUP LTD	24,000	3.98	95,520.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	11,500	22.35	257,025.00	
	HANG SENG BANK	2,400	106.90	256,560.00	
	AIA GROUP LTD	33,600	76.55	2,572,080.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	30,000	6.44	193,200.00	
	SINO LAND CO	10,000	9.30	93,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	1,500	59.85	89,775.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	3,800	18.70	71,060.00	
香港ドル 小計		120,800		3,768,220.00 (68,619,286)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	4,300	6.45	27,735.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	3,800	27.40	104,120.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,400	9.28	22,272.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	7,800	3.22	25,116.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,300	6.76	8,788.00	
シンガポールドル 小計		19,600		188,031.00 (19,897,440)	
イスラエルシェケル	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,525	28.02	126,790.50	
イスラエルシェケル 小計		4,525		126,790.50 (4,890,778)	
合　計		1,533,193		10,634,189,297 (10,634,189,297)	

(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	2,944	28,556.80	
		LENDLEASE GROUP	1,761	13,682.97	
	オーストラリアドル 小計		4,705	42,239.77 (4,023,760)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	11,000	101,530.00	
	香港ドル 小計		11,000	101,530.00 (1,848,861)	
投資信託受益証券合計			15,705	5,872,621 (5,872,621)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	1,344	262,819.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	1,460	28,075.80	
		BOSTON PROPERTIES	522	30,839.76	
		CROWN CASTLE INC	1,207	139,444.71	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	823	93,657.40	
		EQUINIX INC	266	205,434.46	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,586	32,592.30	
		IRON MOUNTAIN INC	950	55,052.50	
		PROLOGIS INC	2,662	324,737.38	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	291	70,087.35	
		WELLTOWER INC	1,473	117,560.13	
	アメリカドル 小計		12,584	1,360,300.99 (193,897,303)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	278	13,813.82	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	550	10,488.50	
	カナダドル 小計		828	24,302.32 (2,607,638)	
	ユーロ	GECINA SA	121	11,434.50	
		KLEPIERRE	568	12,717.52	
	ユーロ 小計		689	24,152.02 (3,774,960)	
	イギリスポンド	SEGRO PLC	3,574	25,361.10	
	イギリスポンド 小計		3,574	25,361.10 (4,636,516)	
	オーストラリアドル	DEXUS	2,715	21,258.45	
		GOODMAN GROUP	4,624	90,722.88	
		GPT GROUP	4,863	19,792.41	
		MIRVAC GROUP	9,992	22,382.08	
		SCENTRE GROUP	15,450	40,324.50	
		STOCKLAND	6,045	23,877.75	
		VICINITY CENTERS	9,869	17,813.54	
			53,558	236,171.61	

	オーストラリアドル 小計			(22,497,707)	
	シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	14,785	27,500.10	
	シンガポールドル 小計		14,785	27,500.10 (2,910,060)	
投資証券合計			86,018	230,324,184 (230,324,184)	
合計				236,196,805 (236,196,805)	

(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　287銘柄	97.6%	—	—	73.0%
	投資証券　11銘柄	—	—	2.4%	1.8%
カナダドル	株式　39銘柄	99.3%	—	—	3.5%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.7%	0.0%
ユーロ	株式　97銘柄	99.6%	—	—	9.3%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.4%	0.0%
イギリスポンド	株式　41銘柄	99.0%	—	—	4.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	1.0%	0.0%
スイスフラン	株式　22銘柄	100.0%	—	—	2.5%
スウェーデンクローナ	株式　22銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.3%
デンマーククローネ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	1.6%
オーストラリアドル	株式　30銘柄	86.7%	—	—	1.6%
	投資信託受益証券　2銘柄	—	2.0%	—	0.0%
	投資証券　7銘柄	—	—	11.2%	0.2%
ニュージーランドドル	株式　4銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式　9銘柄	97.4%	—	—	0.6%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	2.6%	—	0.0%
シンガポールドル	株式　5銘柄	87.2%	—	—	0.2%
	投資証券　1銘柄	—	—	12.8%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　1銘柄	100.0%	—	—	0.0%

(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。

世界債券総合インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	380,440,318
コール・ローン	273,450,657
国債証券	21,342,210,861
地方債証券	1,308,195,815
特殊債券	5,155,295,964
社債券	11,019,026,349
投資信託受益証券	6,027,483,486
派生商品評価勘定	3,618,009
未収入金	390,136,820
未収配当金	15,921,531
未収利息	156,462,873
前払費用	212,439,493
流動資産合計	46,284,682,176
資産合計	46,284,682,176
負債の部	
流動負債	
未払金	69,005,581
未払解約金	450,010,817
未払利息	227
流動負債合計	519,016,625
負債合計	519,016,625
純資産の部	
元本等	
元本	43,830,208,191
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,935,457,360
元本等合計	45,765,665,551
純資産合計	45,765,665,551
負債純資産合計	46,284,682,176

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10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)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)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (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10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	43,830,208,191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 1.0442円 (1万口当たり純資産額) (10,442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 7月10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 7月10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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 4月21日
期首元本額	18,542,000,000円
期中追加設定元本額	26,115,717,014円
期中一部解約元本額	827,508,823円
期末元本額	43,830,208,191円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	628,250,932円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,261,008,406円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,503,268,832円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	37,494,829,938円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	379,636,686円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	81,659,098円
ＦＯＦｓ用　世界債券総合インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	481,554,299円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△410,790,683
地方債証券	△41,724,743
特殊債券	△52,358,719
社債券	△213,149,006
投資信託受益証券	△164,487,597

合計	△882,510,748

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	444,650,523	—	441,032,514	3,618,009
	アメリカドル	266,366,940	—	263,515,966	2,850,974
	カナダドル	11,418,850	—	11,372,231	46,619
	ユーロ	103,650,749	—	103,303,393	347,356
	イギリスポンド	17,603,808	—	17,548,118	55,690
	オーストラリアドル	6,485,976	—	6,476,911	9,065
	オフショア人民元	39,124,200	—	38,815,895	308,305
合計		444,650,523	—	441,032,514	3,618,009

(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	ADGB 1.625% 06/02/28	200,000.00	173,482.00	
		CHILE 2.55% 07/27/33	200,000.00	160,479.83	
		INDON 4.3% 03/31/52	200,000.00	171,599.04	
		INDON 4.35% 01/11/48	200,000.00	175,845.12	
		ISRAEL 4.5% 01/17/33	200,000.00	194,000.00	
		ITALY 1.25% 02/17/26	200,000.00	178,456.20	
		KSA 4.5% 10/26/46	200,000.00	171,697.40	
		KSA 4.875% 07/18/33	200,000.00	197,155.00	
		KSA 5% 01/18/53	200,000.00	181,514.40	
		MEX 4.4% 02/12/52	200,000.00	155,149.09	
		MEX 4.75% 04/27/32	200,000.00	188,586.02	
		PANAMA 2.252% 09/29/32	200,000.00	151,289.37	
		PERU 3.3% 03/11/41	200,000.00	150,826.88	
		PHILIP 3.229% 03/29/27	200,000.00	188,267.95	
		PHILIP 5.17% 10/13/27	200,000.00	201,774.55	
		QATAR 3.4% 04/16/25	200,000.00	193,702.20	
		QATAR 3.75% 04/16/30	200,000.00	189,866.80	
		T 0.25% 05/31/25	1,000,000.00	914,941.41	
		T 0.25% 08/31/25	1,000,000.00	906,777.34	
		T 0.375% 04/30/25	1,000,000.00	920,078.12	
		T 0.375% 09/15/24	1,000,000.00	943,417.97	
		T 0.375% 12/31/25	1,000,000.00	899,511.72	
		T 0.5% 10/31/27	1,000,000.00	846,718.75	
		T 0.625% 05/15/30	1,000,000.00	788,476.56	
		T 0.625% 10/15/24	600,000.00	565,792.96	
		T 0.625% 11/30/27	500,000.00	424,648.44	
		T 0.75% 01/31/28	1,000,000.00	850,292.97	
		T 0.75% 05/31/26	1,000,000.00	894,980.47	
		T 0.75% 08/31/26	1,000,000.00	888,027.34	
		T 0.875% 11/15/30	800,000.00	636,656.24	
		T 1.125% 01/15/25	1,000,000.00	940,820.31	
		T 1.125% 02/15/31	1,000,000.00	808,515.62	
		T 1.125% 05/15/40	100,000.00	62,683.59	
		T 1.125% 08/15/40	300,000.00	186,632.81	
		T 1.125% 10/31/26	1,000,000.00	894,980.47	
		T 1.25% 03/31/28	1,000,000.00	867,207.03	
		T 1.25% 05/15/50	400,000.00	216,226.56	
		T 1.25% 05/31/28	550,000.00	474,987.30	
		T 1.25% 08/15/31	1,000,000.00	805,507.81	
		T 1.25% 09/30/28	500,000.00	428,222.65	
		T 1.25% 11/30/26	1,000,000.00	896,347.66	

		T 1.375% 08/15/50	300,000.00	167,578.12	
		T 1.375% 11/15/31	550,000.00	445,113.28	
		T 1.375% 11/15/40	300,000.00	194,390.62	
		T 1.375% 12/31/28	1,000,000.00	857,578.12	
		T 1.5% 01/31/27	500,000.00	450,273.44	
		T 1.5% 02/15/30	500,000.00	421,953.12	
		T 1.5% 08/15/26	1,000,000.00	910,390.62	
		T 1.5% 11/30/24	1,000,000.00	949,843.75	
		T 1.625% 02/15/26	1,000,000.00	924,296.88	
		T 1.625% 11/15/50	500,000.00	298,808.59	
		T 1.75% 03/15/25	1,000,000.00	946,015.62	
		T 1.75% 08/15/41	400,000.00	272,453.12	
		T 1.875% 02/15/32	1,000,000.00	840,390.62	
		T 1.875% 02/15/51	300,000.00	191,326.17	
		T 1.875% 02/28/27	1,000,000.00	911,152.34	
		T 1.875% 02/28/29	300,000.00	263,625.00	
		T 1.875% 11/15/51	500,000.00	317,763.67	
		T 1% 07/31/28	600,000.00	509,273.43	
		T 1% 12/15/24	1,000,000.00	942,031.25	
		T 2.25% 02/15/52	500,000.00	348,212.88	
		T 2.25% 05/15/41	200,000.00	149,300.78	
		T 2.25% 08/15/46	300,000.00	211,658.20	
		T 2.25% 08/15/49	300,000.00	210,146.48	
		T 2.25% 11/15/24	1,000,000.00	960,742.19	
		T 2.25% 11/15/25	1,000,000.00	943,164.06	
		T 2.375% 02/15/42	250,000.00	188,779.29	
		T 2.375% 05/15/51	650,000.00	466,159.17	
		T 2.375% 11/15/49	300,000.00	215,958.98	
		T 2.5% 02/15/45	400,000.00	299,460.93	
		T 2.5% 02/15/46	200,000.00	148,785.15	
		T 2.5% 03/31/27	400,000.00	372,531.24	
		T 2.5% 05/15/46	200,000.00	148,652.34	
		T 2.625% 02/15/29	1,000,000.00	915,625.00	
		T 2.625% 04/15/25	1,000,000.00	958,769.53	
		T 2.625% 05/31/27	500,000.00	466,611.33	
		T 2.75% 02/28/25	800,000.00	770,546.87	
		T 2.75% 04/30/27	1,000,000.00	938,476.56	
		T 2.75% 05/15/25	1,000,000.00	959,843.75	
		T 2.75% 05/31/29	820,000.00	753,823.44	
		T 2.75% 08/15/42	200,000.00	160,011.71	
		T 2.75% 08/15/47	200,000.00	155,300.78	
		T 2.75% 11/15/42	200,000.00	159,699.21	

		T 2.875% 04/30/29	620,000.00	574,275.00	
		T 2.875% 05/15/43	300,000.00	243,357.42	
		T 2.875% 05/15/49	300,000.00	239,443.35	
		T 2.875% 05/15/52	300,000.00	239,841.79	
		T 2.875% 06/15/25	500,000.00	480,576.17	
		T 2.875% 08/15/45	220,000.00	175,737.88	
		T 2.875% 11/15/46	100,000.00	79,677.73	
		T 2% 02/15/25	1,000,000.00	951,660.16	
		T 2% 02/15/50	550,000.00	363,225.58	
		T 2% 08/15/25	1,000,000.00	942,753.91	
		T 2% 08/15/51	300,000.00	196,962.89	
		T 2% 11/15/41	350,000.00	248,534.18	
		T 3.125% 02/15/42	200,000.00	170,785.15	
		T 3.125% 02/15/43	300,000.00	253,798.82	
		T 3.125% 05/15/48	100,000.00	83,357.42	
		T 3.125% 08/15/44	300,000.00	251,419.92	
		T 3.125% 08/31/27	1,000,000.00	949,296.88	
		T 3.125% 08/31/29	1,000,000.00	937,187.50	
		T 3.125% 11/15/28	1,000,000.00	942,324.22	
		T 3.25% 05/15/42	300,000.00	259,945.31	
		T 3.25% 06/30/27	1,000,000.00	955,117.19	
		T 3.25% 08/31/24	1,000,000.00	976,406.25	
		T 3.375% 08/15/42	300,000.00	264,363.28	
		T 3.375% 11/15/48	600,000.00	523,933.58	
		T 3.5% 02/15/33	150,000.00	143,226.56	
		T 3.5% 02/15/39	400,000.00	373,164.06	
		T 3.625% 02/15/44	300,000.00	272,455.07	
		T 3.625% 02/15/53	300,000.00	277,921.87	
		T 3.625% 08/15/43	350,000.00	318,370.11	
		T 3.75% 11/15/43	300,000.00	277,746.09	
		T 3.875% 02/15/43	300,000.00	284,156.25	
		T 3.875% 12/31/29	250,000.00	244,355.47	
		T 3% 02/15/49	500,000.00	408,535.15	
		T 3% 05/15/45	200,000.00	163,503.90	
		T 3% 07/15/25	1,000,000.00	962,792.97	
		T 3% 08/15/48	300,000.00	244,505.85	
		T 3% 08/15/52	300,000.00	245,982.42	
		T 3% 11/15/44	250,000.00	204,829.10	
		T 4.125% 11/15/32	300,000.00	300,750.00	
		T 4.25% 09/30/24	1,000,000.00	986,835.94	
		T 4.375% 11/15/39	300,000.00	309,187.50	
		T 4.5% 05/15/38	300,000.00	314,830.07	
		T 4.5% 08/15/39	300,000.00	314,085.93	

	T 4.75% 02/15/41	200,000.00	214,902.34	
	T 4% 11/15/42	200,000.00	192,953.12	
	T 4% 11/15/52	200,000.00	198,390.62	
	T 5.0% 05/15/37	200,000.00	221,191.40	
	URUGUA 4.375% 10/27/27	100,000.00	98,809.87	
アメリカドル 小計		68,960,000.00	60,680,124.82 (8,649,344,991)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	300,000.00	268,853.02	
	CAN 0.5% 09/01/25	290,000.00	265,695.99	
	CAN 0.5% 12/01/30	290,000.00	230,956.29	
	CAN 1.25% 03/01/27	300,000.00	270,775.76	
	CAN 1.25% 06/01/30	100,000.00	85,257.91	
	CAN 1.5% 06/01/31	200,000.00	170,708.42	
	CAN 1.5% 12/01/31	160,000.00	135,527.25	
	CAN 1.75% 12/01/53	40,000.00	27,955.32	
	CAN 1% 09/01/26	300,000.00	271,505.88	
	CAN 2.25% 06/01/29	200,000.00	184,774.85	
	CAN 2.75% 06/01/33	40,000.00	37,311.00	
	CAN 2.75% 08/01/24	110,000.00	107,331.35	
	CAN 2.75% 09/01/27	150,000.00	142,532.43	
	CAN 2.75% 12/01/48	270,000.00	241,092.70	
	CAN 2.75% 12/01/64	50,000.00	43,377.30	
	CAN 2% 06/01/32	80,000.00	70,256.34	
	CAN 2% 12/01/51	250,000.00	188,124.38	
	CAN 3.5% 12/01/45	160,000.00	161,636.48	
	CAN 3.75% 02/01/25	580,000.00	569,919.92	
	CAN 4.0% 06/01/41	200,000.00	213,481.18	
	CAN 5.75% 06/01/33	80,000.00	94,249.56	
	CAN 5% 06/01/37	140,000.00	162,027.85	
カナダドル 小計		4,290,000.00	3,943,351.18 (423,121,581)	
メキシコペソ	MBONO 10% 12/05/24	2,700,000.00	2,681,379.36	
	MBONO 5.5% 03/04/27	2,100,000.00	1,847,181.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	2,500,000.00	2,269,526.65	
	MBONO 5% 03/06/25	2,200,000.00	2,031,678.00	
	MBONO 7.5% 05/26/33	800,000.00	727,576.00	
	MBONO 7.5% 06/03/27	1,800,000.00	1,696,374.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	2,750,000.00	2,574,412.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	1,700,000.00	1,500,301.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	1,000,000.00	919,010.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	1,600,000.00	1,567,952.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	1,150,000.00	1,104,471.50	

	MBONO 8% 07/31/53	900,000.00	804,141.00	
	MBONO 8% 11/07/47	1,730,000.00	1,557,847.70	
メキシコペソ 小計		22,930,000.00	21,281,850.71 (177,009,665)	
ユーロ	BGARIA 4.125% 09/23/29	100,000.00	98,269.50	
	BGB 0.1% 06/22/30	100,000.00	81,610.07	
	BGB 0.35% 06/22/32	100,000.00	77,928.95	
	BGB 0.4% 06/22/40	60,000.00	36,438.78	
	BGB 0.5% 10/22/24	40,000.00	38,520.00	
	BGB 0.65% 06/22/71	60,000.00	23,273.10	
	BGB 0.8% 06/22/25	100,000.00	95,375.98	
	BGB 0.8% 06/22/27	130,000.00	118,947.92	
	BGB 0.8% 06/22/28	170,000.00	152,653.54	
	BGB 0.9% 06/22/29	60,000.00	53,092.86	
	BGB 0% 10/22/31	50,000.00	38,606.95	
	BGB 1.25% 04/22/33	60,000.00	50,371.50	
	BGB 1.4% 06/22/53	50,000.00	30,358.30	
	BGB 1.45% 06/22/37	50,000.00	39,245.00	
	BGB 1.6% 06/22/47	50,000.00	34,359.25	
	BGB 1.7% 06/22/50	80,000.00	54,491.20	
	BGB 1.9% 06/22/38	30,000.00	24,548.91	
	BGB 1% 06/22/26	120,000.00	112,791.60	
	BGB 1% 06/22/31	180,000.00	153,166.86	
	BGB 2.15% 06/22/66	30,000.00	21,379.50	
	BGB 2.25% 06/22/57	60,000.00	45,081.84	
	BGB 2.75% 04/22/39	80,000.00	72,836.24	
	BGB 3.3% 06/22/54	30,000.00	28,191.77	
	BGB 3.75% 06/22/45	70,000.00	72,163.28	
	BGB 3% 06/22/33	100,000.00	97,545.14	
	BGB 3% 06/22/34	70,000.00	67,949.41	
	BGB 4.25% 03/28/41	70,000.00	76,739.20	
	BGB 4.5% 03/28/26	100,000.00	103,317.10	
	BGB 5.5% 03/28/28	140,000.00	154,824.74	
	BGB 5% 03/28/35	90,000.00	103,929.39	
	BKO 0.4% 09/13/24	50,000.00	48,293.55	
	BKO 2.2% 12/12/24	370,000.00	364,083.33	
	BTPS 0.25% 03/15/28	90,000.00	76,271.31	
	BTPS 0.35% 02/01/25	170,000.00	161,206.58	
	BTPS 0.45% 02/15/29	100,000.00	82,679.50	
	BTPS 0.5% 02/01/26	250,000.00	230,065.25	
	BTPS 0.6% 08/01/31	150,000.00	114,449.70	
	BTPS 0.85% 01/15/27	200,000.00	180,877.00	
	BTPS 0.9% 04/01/31	120,000.00	95,085.60	

		BTPS 0.95% 03/01/37	50,000.00	32,601.70	
		BTPS 0.95% 06/01/32	100,000.00	76,474.10	
		BTPS 0.95% 08/01/30	200,000.00	162,596.60	
		BTPS 0.95% 09/15/27	90,000.00	80,151.00	
		BTPS 0.95% 12/01/31	130,000.00	101,138.29	
		BTPS 0% 04/01/26	100,000.00	90,237.00	
		BTPS 0% 08/01/26	160,000.00	142,590.40	
		BTPS 1.25% 12/01/26	100,000.00	92,029.60	
		BTPS 1.35% 04/01/30	150,000.00	126,785.10	
		BTPS 1.45% 03/01/36	100,000.00	71,874.40	
		BTPS 1.45% 05/15/25	70,000.00	67,137.98	
		BTPS 1.5% 04/30/45	70,000.00	41,464.09	
		BTPS 1.5% 06/01/25	250,000.00	239,622.25	
		BTPS 1.6% 06/01/26	150,000.00	141,082.50	
		BTPS 1.65% 03/01/32	170,000.00	139,811.06	
		BTPS 1.65% 12/01/30	150,000.00	127,175.55	
		BTPS 1.7% 09/01/51	130,000.00	74,183.85	
		BTPS 1.75% 07/01/24	40,000.00	39,206.60	
		BTPS 1.8% 03/01/41	80,000.00	54,183.66	
		BTPS 2.05% 08/01/27	110,000.00	102,778.50	
		BTPS 2.1% 07/15/26	170,000.00	161,875.36	
		BTPS 2.15% 03/01/72	30,000.00	16,865.86	
		BTPS 2.15% 09/01/52	80,000.00	50,006.48	
		BTPS 2.2% 06/01/27	70,000.00	65,997.33	
		BTPS 2.25% 09/01/36	130,000.00	102,526.84	
		BTPS 2.45% 09/01/33	100,000.00	85,213.00	
		BTPS 2.45% 09/01/50	50,000.00	34,245.97	
		BTPS 2.5% 11/15/25	180,000.00	175,014.00	
		BTPS 2.5% 12/01/24	220,000.00	216,283.10	
		BTPS 2.5% 12/01/32	80,000.00	69,638.40	
		BTPS 2.7% 03/01/47	120,000.00	89,449.20	
		BTPS 2.8% 03/01/67	60,000.00	40,937.98	
		BTPS 2.8% 06/15/29	130,000.00	122,033.08	
		BTPS 2.8% 12/01/28	150,000.00	142,222.65	
		BTPS 2.95% 09/01/38	60,000.00	50,145.00	
		BTPS 2% 02/01/28	200,000.00	184,780.00	
		BTPS 2% 12/01/25	300,000.00	287,962.20	
		BTPS 3.1% 03/01/40	90,000.00	75,287.52	
		BTPS 3.25% 03/01/38	40,000.00	34,702.83	
		BTPS 3.25% 09/01/46	90,000.00	74,117.52	
		BTPS 3.35% 03/01/35	120,000.00	108,617.04	
		BTPS 3.4% 04/01/28	100,000.00	97,987.50	

		BTPS 3.45% 03/01/48	70,000.00	59,119.62	
		BTPS 3.5% 03/01/30	100,000.00	97,284.60	
		BTPS 3.7% 06/15/30	80,000.00	78,302.80	
		BTPS 3.75% 09/01/24	200,000.00	199,861.40	
		BTPS 3.85% 09/01/49	70,000.00	62,782.58	
		BTPS 3.85% 12/15/29	150,000.00	148,672.50	
		BTPS 3% 08/01/29	80,000.00	75,994.56	
		BTPS 4.35% 11/01/33	70,000.00	70,267.40	
		BTPS 4.4% 05/01/33	130,000.00	131,595.88	
		BTPS 4.45% 09/01/43	100,000.00	98,244.40	
		BTPS 4.5% 03/01/26	80,000.00	81,393.76	
		BTPS 4.5% 10/01/53	30,000.00	29,441.40	
		BTPS 4.75% 09/01/28	200,000.00	208,042.00	
		BTPS 4.75% 09/01/44	100,000.00	102,435.70	
		BTPS 4% 02/01/37	130,000.00	124,720.70	
		BTPS 4% 04/30/35	140,000.00	135,099.07	
		BTPS 4% 10/30/31	50,000.00	49,617.00	
		BTPS 5.0% 08/01/39	140,000.00	147,765.80	
		BTPS 5.25% 11/01/29	200,000.00	214,863.60	
		BTPS 5.75% 02/01/33	80,000.00	89,336.00	
		BTPS 5% 03/01/25	250,000.00	254,607.47	
		BTPS 5% 08/01/34	100,000.00	105,555.01	
		BTPS 5% 09/01/40	130,000.00	137,507.50	
		BTPS 6.5% 11/01/27	200,000.00	221,319.60	
		BTPS 6% 05/01/31	100,000.00	113,010.40	
		DBR 0.25% 02/15/27	300,000.00	273,732.30	
		DBR 0.25% 08/15/28	400,000.00	354,063.20	
		DBR 0% 02/15/31	350,000.00	288,233.75	
		DBR 0% 02/15/32	420,000.00	337,270.50	
		DBR 0% 08/15/26	600,000.00	548,929.80	
		DBR 0% 08/15/29	330,000.00	281,613.52	
		DBR 0% 08/15/30	480,000.00	400,121.28	
		DBR 0% 08/15/31	100,000.00	81,353.40	
		DBR 0% 08/15/50	330,000.00	166,331.22	
		DBR 0% 08/15/52	130,000.00	62,296.13	
		DBR 1.25% 08/15/48	220,000.00	166,172.82	
		DBR 1.7% 08/15/32	220,000.00	204,059.02	
		DBR 1.8% 08/15/53	230,000.00	190,486.92	
		DBR 1% 05/15/38	420,000.00	332,464.39	
		DBR 2.3% 02/15/33	200,000.00	194,451.40	
		DBR 2.5% 07/04/44	120,000.00	116,473.80	
		DBR 2.5% 08/15/46	260,000.00	253,819.28	
		DBR 3.25% 07/04/42	170,000.00	183,087.56	

		DBR 4.0% 01/04/37	280,000.00	320,205.81	
		DBR 4.25% 07/04/39	50,000.00	59,668.00	
		DBR 4.75% 07/04/28	300,000.00	328,287.45	
		DBR 4.75% 07/04/34	100,000.00	119,777.40	
		FRTR 0.25% 11/25/26	200,000.00	181,661.00	
		FRTR 0.5% 05/25/26	280,000.00	259,594.16	
		FRTR 0.5% 05/25/29	300,000.00	259,486.50	
		FRTR 0.5% 05/25/40	180,000.00	113,827.14	
		FRTR 0.5% 05/25/72	60,000.00	21,970.44	
		FRTR 0.5% 06/25/44	110,000.00	62,747.63	
		FRTR 0.75% 02/25/28	200,000.00	180,110.00	
		FRTR 0.75% 05/25/28	250,000.00	224,020.75	
		FRTR 0.75% 05/25/52	180,000.00	92,849.76	
		FRTR 0.75% 05/25/53	210,000.00	105,579.49	
		FRTR 0.75% 11/25/28	370,000.00	328,340.09	
		FRTR 0% 02/25/25	380,000.00	359,698.50	
		FRTR 0% 02/25/26	400,000.00	367,912.00	
		FRTR 0% 02/25/27	300,000.00	268,332.60	
		FRTR 0% 03/25/25	300,000.00	283,341.90	
		FRTR 0% 05/25/32	250,000.00	190,666.00	
		FRTR 0% 11/25/29	300,000.00	247,973.74	
		FRTR 0% 11/25/30	370,000.00	296,480.72	
		FRTR 0% 11/25/31	220,000.00	170,707.68	
		FRTR 1.25% 05/25/34	280,000.00	229,677.84	
		FRTR 1.25% 05/25/36	270,000.00	212,267.52	
		FRTR 1.25% 05/25/38	50,000.00	37,665.00	
		FRTR 1.5% 05/25/31	300,000.00	268,275.30	
		FRTR 1.5% 05/25/50	180,000.00	119,432.16	
		FRTR 1.75% 05/25/66	110,000.00	71,025.79	
		FRTR 1.75% 06/25/39	170,000.00	137,287.58	
		FRTR 1.75% 11/25/24	270,000.00	263,937.42	
		FRTR 1% 05/25/27	250,000.00	230,948.87	
		FRTR 1% 11/25/25	140,000.00	132,844.32	
		FRTR 2.5% 05/25/30	200,000.00	193,588.82	
		FRTR 2.5% 05/25/43	60,000.00	51,738.60	
		FRTR 2.75% 10/25/27	450,000.00	444,001.50	
		FRTR 2% 05/25/48	150,000.00	113,844.45	
		FRTR 2% 11/25/32	200,000.00	181,760.50	
		FRTR 3.25% 05/25/45	180,000.00	174,459.60	
		FRTR 3.5% 04/25/26	300,000.00	302,230.98	
		FRTR 3% 05/25/33	100,000.00	98,515.60	
		FRTR 3% 05/25/54	40,000.00	36,181.88	

		FRTR 4.5% 04/25/41	220,000.00	251,719.64	
		FRTR 4.75% 04/25/35	130,000.00	148,351.64	
		FRTR 4% 04/25/55	110,000.00	120,645.89	
		FRTR 4% 04/25/60	100,000.00	111,060.00	
		FRTR 4% 10/25/38	140,000.00	150,414.18	
		FRTR 5.5% 04/25/29	420,000.00	473,184.60	
		FRTR 5.75% 10/25/32	250,000.00	301,927.75	
		IRISH 0.2% 05/15/27	60,000.00	53,736.27	
		IRISH 0.2% 10/18/30	60,000.00	48,997.42	
		IRISH 0.35% 10/18/32	40,000.00	31,398.98	
		IRISH 0.4% 05/15/35	50,000.00	36,474.00	
		IRISH 0.55% 04/22/41	20,000.00	12,548.74	
		IRISH 0.9% 05/15/28	40,000.00	36,229.78	
		IRISH 0% 10/18/31	120,000.00	93,755.76	
		IRISH 1.1% 05/15/29	70,000.00	62,821.92	
		IRISH 1.5% 05/15/50	50,000.00	33,625.65	
		IRISH 1.7% 05/15/37	60,000.00	49,223.22	
		IRISH 1% 05/15/26	70,000.00	65,972.10	
		IRISH 2% 02/18/45	70,000.00	55,052.20	
		IRISH 3% 10/18/43	20,000.00	19,021.02	
		IRISH 5.4% 03/13/25	90,000.00	93,113.48	
		ISRAEL 1.5% 01/16/29	100,000.00	88,708.60	
		ISRAEL 2.5% 01/16/49	100,000.00	76,612.86	
		NETHER 0.25% 07/15/25	110,000.00	103,647.31	
		NETHER 0.25% 07/15/29	60,000.00	51,261.84	
		NETHER 0.5% 01/15/40	80,000.00	54,348.23	
		NETHER 0.5% 07/15/26	70,000.00	64,842.56	
		NETHER 0.5% 07/15/32	110,000.00	89,101.56	
		NETHER 0.75% 07/15/27	100,000.00	91,619.90	
		NETHER 0.75% 07/15/28	80,000.00	71,875.31	
		NETHER 0% 01/15/26	90,000.00	83,199.87	
		NETHER 0% 01/15/27	130,000.00	116,988.82	
		NETHER 0% 01/15/29	100,000.00	85,179.55	
		NETHER 0% 01/15/38	60,000.00	38,864.40	
		NETHER 0% 01/15/52	120,000.00	54,714.68	
		NETHER 0% 07/15/30	60,000.00	49,074.00	
		NETHER 0% 07/15/31	80,000.00	63,623.04	
		NETHER 2.5% 01/15/30	40,000.00	38,902.56	
		NETHER 2.5% 01/15/33	80,000.00	77,136.00	
		NETHER 2.5% 07/15/33	40,000.00	38,526.48	
		NETHER 2.75% 01/15/47	100,000.00	97,620.80	
		NETHER 2% 01/15/54	30,000.00	24,684.78	
		NETHER 2% 07/15/24	120,000.00	118,271.88	

		NETHER 3.75% 01/15/42	120,000.00	132,847.32	
		NETHER 4% 01/15/37	120,000.00	132,790.25	
		NETHER 5.5% 01/15/28	20,000.00	22,087.68	
		OBL 0% 04/10/26	200,000.00	184,238.80	
		OBL 0% 04/16/27	400,000.00	360,002.40	
		OBL 0% 10/18/24	350,000.00	335,390.69	
		OBL 1.3% 10/15/27	500,000.00	470,398.10	
		PGB 0.3% 10/17/31	70,000.00	55,209.14	
		PGB 0.475% 10/18/30	70,000.00	57,795.78	
		PGB 0.7% 10/15/27	100,000.00	90,590.40	
		PGB 1.15% 04/11/42	70,000.00	46,289.22	
		PGB 1.95% 06/15/29	100,000.00	93,588.28	
		PGB 2.125% 10/17/28	100,000.00	95,183.50	
		PGB 2.875% 10/15/25	100,000.00	99,606.63	
		PGB 4.1% 02/15/45	50,000.00	52,980.10	
		PGB 4.1% 04/15/37	120,000.00	125,296.44	
		PGB 4.125% 04/14/27	100,000.00	103,676.20	
		POLAND 2.375% 01/18/36	100,000.00	81,944.00	
		RAGB 0.25% 10/20/36	50,000.00	33,886.75	
		RAGB 0.5% 02/20/29	100,000.00	86,625.50	
		RAGB 0.5% 04/20/27	160,000.00	145,100.00	
		RAGB 0.7% 04/20/71	20,000.00	8,510.22	
		RAGB 0.75% 02/20/28	100,000.00	89,889.40	
		RAGB 0.75% 03/20/51	40,000.00	22,067.84	
		RAGB 0.75% 10/20/26	90,000.00	83,378.79	
		RAGB 0.85% 06/30/20	30,000.00	11,741.34	
		RAGB 0.9% 02/20/32	80,000.00	66,298.56	
		RAGB 0% 02/20/30	100,000.00	81,399.80	
		RAGB 0% 02/20/31	80,000.00	62,963.04	
		RAGB 0% 04/20/25	90,000.00	84,870.00	
		RAGB 0% 10/20/28	50,000.00	42,459.25	
		RAGB 0% 10/20/40	20,000.00	11,456.12	
		RAGB 1.2% 10/20/25	130,000.00	124,306.65	
		RAGB 1.5% 02/20/47	40,000.00	28,354.00	
		RAGB 1.5% 11/02/86	20,000.00	11,338.14	
		RAGB 1.65% 10/21/24	40,000.00	39,162.56	
		RAGB 1.85% 05/23/49	50,000.00	37,782.70	
		RAGB 2.1% 09/20/17	40,000.00	27,820.00	
		RAGB 2.4% 05/23/34	60,000.00	55,347.06	
		RAGB 2.9% 02/20/33	50,000.00	48,533.65	
		RAGB 3.15% 06/20/44	60,000.00	58,855.14	
		RAGB 3.8% 01/26/62	20,000.00	22,302.58	

		RAGB 4.15% 03/15/37	60,000.00	65,117.88	
		RAGB 4.85% 03/15/26	70,000.00	72,951.16	
		RFGB 0.125% 04/15/36	50,000.00	33,627.50	
		RFGB 0.125% 04/15/52	20,000.00	8,808.74	
		RFGB 0.125% 09/15/31	50,000.00	39,218.29	
		RFGB 0.25% 09/15/40	30,000.00	18,102.36	
		RFGB 0.5% 04/15/26	40,000.00	37,235.16	
		RFGB 0.5% 04/15/43	30,000.00	17,937.00	
		RFGB 0.5% 09/15/27	30,000.00	26,960.16	
		RFGB 0.5% 09/15/28	60,000.00	52,652.66	
		RFGB 0.5% 09/15/29	50,000.00	42,844.20	
		RFGB 0.75% 04/15/31	50,000.00	41,945.81	
		RFGB 0.875% 09/15/25	50,000.00	47,519.65	
		RFGB 1.125% 04/15/34	20,000.00	16,214.32	
		RFGB 1.375% 04/15/27	50,000.00	46,871.55	
		RFGB 1.375% 04/15/47	30,000.00	21,155.65	
		RFGB 1.5% 09/15/32	40,000.00	34,714.67	
		RFGB 2.625% 07/04/42	30,000.00	27,325.83	
		RFGB 2.75% 04/15/38	20,000.00	18,610.13	
		RFGB 4% 07/04/25	50,000.00	50,588.61	
		ROMANI 2.125% 03/07/28	100,000.00	86,612.96	
		ROMANI 2.75% 02/26/26	100,000.00	95,012.80	
		ROMANI 2.75% 04/14/41	100,000.00	60,327.70	
		ROMANI 2% 01/28/32	100,000.00	72,510.90	
		ROMANI 3.624% 05/26/30	100,000.00	87,104.00	
		ROMANI 5% 09/27/26	100,000.00	100,217.20	
		SPGB 0.1% 04/30/31	100,000.00	77,225.30	
		SPGB 0.5% 04/30/30	200,000.00	165,019.40	
		SPGB 0.5% 10/31/31	150,000.00	117,978.17	
		SPGB 0.6% 10/31/29	50,000.00	42,163.35	
		SPGB 0.7% 04/30/32	120,000.00	94,686.72	
		SPGB 0.8% 07/30/29	200,000.00	171,606.86	
		SPGB 0.85% 07/30/37	130,000.00	88,267.92	
		SPGB 0% 01/31/25	160,000.00	151,537.60	
		SPGB 0% 01/31/26	130,000.00	119,185.95	
		SPGB 0% 01/31/27	230,000.00	203,909.26	
		SPGB 0% 01/31/28	100,000.00	85,775.40	
		SPGB 1.2% 10/31/40	100,000.00	66,167.56	
		SPGB 1.25% 10/31/30	100,000.00	85,966.80	
		SPGB 1.4% 04/30/28	260,000.00	237,377.14	
		SPGB 1.4% 07/30/28	150,000.00	136,293.24	
		SPGB 1.45% 04/30/29	200,000.00	179,835.20	
		SPGB 1.45% 10/31/27	280,000.00	258,268.36	

	SPGB 1.45% 10/31/71	100,000.00	45,906.18	
	SPGB 1.6% 04/30/25	180,000.00	174,101.72	
	SPGB 1.85% 07/30/35	120,000.00	98,280.00	
	SPGB 1.9% 10/31/52	110,000.00	69,672.90	
	SPGB 1.95% 04/30/26	140,000.00	134,491.84	
	SPGB 1.95% 07/30/30	200,000.00	181,617.00	
	SPGB 1% 07/30/42	100,000.00	60,906.00	
	SPGB 1% 10/31/50	140,000.00	71,468.60	
	SPGB 2.15% 10/31/25	250,000.00	243,121.50	
	SPGB 2.35% 07/30/33	150,000.00	134,102.62	
	SPGB 2.55% 10/31/32	200,000.00	183,958.40	
	SPGB 2.7% 10/31/48	80,000.00	63,617.20	
	SPGB 2.75% 10/31/24	220,000.00	217,735.54	
	SPGB 2.8% 05/31/26	200,000.00	196,297.20	
	SPGB 2.9% 10/31/46	80,000.00	67,035.20	
	SPGB 3.15% 04/30/33	70,000.00	67,311.86	
	SPGB 3.45% 07/30/43	110,000.00	101,494.80	
	SPGB 3.45% 07/30/66	50,000.00	43,667.70	
	SPGB 3.9% 07/30/39	50,000.00	49,743.97	
	SPGB 4.2% 01/31/37	100,000.00	104,086.20	
	SPGB 4.65% 07/30/25	200,000.00	204,587.00	
	SPGB 4.7% 07/30/41	140,000.00	154,001.68	
	SPGB 4.9% 07/30/40	100,000.00	112,184.45	
	SPGB 5.15% 10/31/28	200,000.00	216,586.60	
	SPGB 5.15% 10/31/44	100,000.00	116,587.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	230,000.00	269,323.10	
	SPGB 5.9% 07/30/26	210,000.00	224,638.13	
ユーロ 小計		42,630,000.00	38,177,195.12 (5,967,095,597)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/30/26	250,000.00	219,912.50	
	UKT 0.125% 01/31/28	190,000.00	152,883.50	
	UKT 0.25% 01/31/25	200,000.00	184,871.68	
	UKT 0.25% 07/31/31	230,000.00	163,125.20	
	UKT 0.375% 10/22/26	250,000.00	213,512.50	
	UKT 0.375% 10/22/30	230,000.00	169,717.00	
	UKT 0.5% 01/31/29	220,000.00	173,404.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	190,000.00	55,818.20	
	UKT 0.625% 06/07/25	300,000.00	274,538.76	
	UKT 0.625% 07/31/35	200,000.00	125,868.80	
	UKT 0.625% 10/22/50	200,000.00	76,668.00	
	UKT 0.875% 01/31/46	200,000.00	93,620.00	
	UKT 0.875% 07/31/33	180,000.00	126,105.01	

		UKT 0.875% 10/22/29	100,000.00	79,407.12	
		UKT 1.125% 01/31/39	230,000.00	138,593.40	
		UKT 1.125% 10/22/73	70,000.00	25,415.60	
		UKT 1.25% 07/22/27	300,000.00	258,819.00	
		UKT 1.25% 07/31/51	200,000.00	94,060.00	
		UKT 1.25% 10/22/41	270,000.00	155,460.06	
		UKT 1.5% 07/22/26	100,000.00	89,775.52	
		UKT 1.5% 07/22/47	180,000.00	97,142.40	
		UKT 1.5% 07/31/53	50,000.00	24,769.38	
		UKT 1.625% 10/22/28	250,000.00	212,932.00	
		UKT 1.625% 10/22/54	150,000.00	76,540.50	
		UKT 1.625% 10/22/71	200,000.00	92,814.40	
		UKT 1.75% 01/22/49	220,000.00	124,112.56	
		UKT 1.75% 07/22/57	150,000.00	78,732.00	
		UKT 1.75% 09/07/37	100,000.00	69,234.42	
		UKT 1% 01/31/32	200,000.00	149,270.00	
		UKT 2.5% 07/22/65	90,000.00	57,363.30	
		UKT 2.75% 09/07/24	450,000.00	436,292.82	
		UKT 2% 09/07/25	430,000.00	399,955.04	
		UKT 3.25% 01/22/44	200,000.00	160,100.00	
		UKT 3.25% 01/31/33	50,000.00	44,649.78	
		UKT 3.5% 01/22/45	190,000.00	157,141.40	
		UKT 3.5% 07/22/68	100,000.00	82,299.00	
		UKT 3.75% 01/29/38	100,000.00	89,041.00	
		UKT 3.75% 07/22/52	200,000.00	170,840.00	
		UKT 3.75% 10/22/53	120,000.00	102,001.20	
		UKT 4.125% 01/29/27	380,000.00	364,716.17	
		UKT 4.25% 03/07/36	140,000.00	134,044.68	
		UKT 4.25% 06/07/32	200,000.00	195,365.20	
		UKT 4.25% 09/07/39	230,000.00	216,321.90	
		UKT 4.25% 12/07/40	120,000.00	112,356.00	
		UKT 4.25% 12/07/46	60,000.00	55,509.90	
		UKT 4.25% 12/07/49	130,000.00	120,517.04	
		UKT 4.25% 12/07/55	160,000.00	150,309.12	
		UKT 4.5% 09/07/34	150,000.00	147,886.44	
		UKT 4.5% 12/07/42	100,000.00	96,444.48	
		UKT 4.75% 12/07/30	350,000.00	352,162.58	
		UKT 4.75% 12/07/38	70,000.00	69,867.00	
		UKT 4% 01/22/60	100,000.00	91,161.00	
		UKT 4% 10/22/63	50,000.00	45,572.50	
		UKT 5% 03/07/25	250,000.00	248,542.60	
		UKT 6.0% 12/07/28	70,000.00	73,590.30	

イギリスポンド 小計		10,100,000.00	7,971,173.96 (1,457,290,023)	
スイスフラン	SWISS 0.5% 05/24/55	50,000.00	44,148.50	
	SWISS 0.5% 05/27/30	80,000.00	77,191.84	
	SWISS 0.5% 05/30/58	40,000.00	35,481.60	
	SWISS 0.5% 06/27/32	190,000.00	181,691.30	
	SWISS 0.5% 06/28/45	40,000.00	36,075.20	
	SWISS 0% 06/22/29	300,000.00	282,054.00	
	SWISS 0% 07/24/39	100,000.00	84,736.60	
	SWISS 1.25% 05/28/26	120,000.00	120,302.40	
	SWISS 1.5% 07/24/25	290,000.00	291,591.81	
	SWISS 2.25% 06/22/31	80,000.00	87,380.16	
	SWISS 2.5% 03/08/36	160,000.00	187,482.72	
	SWISS 2% 06/25/64	10,000.00	14,162.18	
	SWISS 3.5% 04/08/33	30,000.00	36,864.84	
	SWISS 4% 04/08/28	200,000.00	227,026.80	
スイスフラン 小計		1,690,000.00	1,706,189.95 (273,416,939)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	500,000.00	410,671.00	
	SGB 0.75% 05/12/28	840,000.00	761,889.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	500,000.00	443,787.86	
	SGB 1.75% 11/11/33	200,000.00	185,447.20	
	SGB 1% 11/12/26	570,000.00	532,499.30	
	SGB 2.25% 06/01/32	650,000.00	628,077.81	
	SGB 2.5% 05/12/25	600,000.00	589,716.43	
	SGB 3.5% 03/30/39	280,000.00	309,148.00	
スウェーデンクローナ 小計		4,140,000.00	3,861,236.60 (50,852,486)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	200,000.00	165,024.40	
	NGB 1.375% 08/19/30	310,000.00	263,991.28	
	NGB 1.5% 02/19/26	330,000.00	309,455.52	
	NGB 1.75% 02/17/27	390,000.00	361,498.80	
	NGB 1.75% 03/13/25	470,000.00	452,109.26	
	NGB 1.75% 09/06/29	400,000.00	354,917.60	
	NGB 2.125% 05/18/32	450,000.00	395,625.15	
	NGB 2% 04/26/28	280,000.00	257,236.00	
	NGB 3% 08/15/33	330,000.00	311,075.16	
ノルウェークローネ 小計		3,160,000.00	2,870,933.17 (38,499,213)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	350,000.00	175,186.02	
	DGB 0.5% 11/15/27	1,200,000.00	1,081,413.24	
	DGB 0.5% 11/15/29	500,000.00	432,413.00	
	DGB 0% 11/15/24	910,000.00	869,560.72	

	DGB 0% 11/15/31	570,000.00	451,484.20	
	DGB 1.75% 11/15/25	1,150,000.00	1,111,854.50	
	DGB 4.5% 11/15/39	630,000.00	757,138.21	
デンマーククローネ 小計		5,310,000.00	4,879,049.89 (102,362,466)	
チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	1,200,000.00	1,020,402.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	1,000,000.00	794,299.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	1,550,000.00	1,229,801.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	400,000.00	374,876.80	
	CZGB 1.5% 04/24/40	1,000,000.00	646,080.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	800,000.00	647,400.00	
	CZGB 1.95% 07/30/37	300,000.00	223,500.00	
	CZGB 1% 06/26/26	900,000.00	800,874.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	1,500,000.00	1,411,410.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	1,500,000.00	1,358,718.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	1,400,000.00	1,271,256.00	
	CZGB 2% 10/13/33	500,000.00	402,533.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	800,000.00	779,224.00	
	CZGB 6% 02/26/26	600,000.00	615,000.00	
チェココルナ 小計		13,450,000.00	11,575,373.80 (75,836,061)	
ハンガリーフォリント	HGB 1% 11/26/25	10,000,000.00	8,323,000.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	10,000,000.00	6,725,000.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	8,000,000.00	5,126,400.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	15,000,000.00	13,524,750.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	10,000,000.00	8,239,632.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	13,000,000.00	9,915,750.00	
	HGB 3% 08/21/30	8,000,000.00	6,160,800.00	
	HGB 3% 10/27/27	11,000,000.00	9,081,050.00	
	HGB 3% 10/27/38	7,000,000.00	4,460,750.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	8,000,000.00	7,386,075.20	
	HGB 6.75% 10/22/28	11,000,000.00	10,443,585.90	
ハンガリーフォリント 小計		111,000,000.00	89,386,793.10 (36,339,128)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.75% 04/25/25	430,000.00	394,675.50	
	POLGB 1.25% 10/25/30	200,000.00	148,697.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	210,000.00	153,195.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	290,000.00	277,153.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	250,000.00	228,284.50	
	POLGB 2.5% 07/25/27	200,000.00	177,930.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	300,000.00	264,297.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	230,000.00	195,789.80	

	POLGB 3.25% 07/25/25	150,000.00	143,338.50	
	POLGB 3.75% 05/25/27	390,000.00	365,632.80	
	POLGB 6% 10/25/33	200,000.00	203,600.00	
	POLGB 7.5% 07/25/28	200,000.00	215,710.00	
ポーランドズロチ 小計		3,050,000.00	2,768,303.10 (97,143,908)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	290,000.00	274,030.10	
	ACGB 0.5% 09/21/26	80,000.00	71,161.11	
	ACGB 1.25% 05/21/32	200,000.00	156,050.48	
	ACGB 1.75% 06/21/51	100,000.00	56,894.54	
	ACGB 1.75% 11/21/32	300,000.00	242,524.21	
	ACGB 1% 11/21/31	500,000.00	386,752.13	
	ACGB 1% 12/21/30	280,000.00	222,758.95	
	ACGB 2.25% 05/21/28	380,000.00	347,946.27	
	ACGB 2.5% 05/21/30	350,000.00	314,474.61	
	ACGB 2.75% 05/21/41	60,000.00	47,471.10	
	ACGB 2.75% 06/21/35	270,000.00	231,166.75	
	ACGB 2.75% 11/21/28	100,000.00	93,158.24	
	ACGB 2.75% 11/21/29	250,000.00	229,875.30	
	ACGB 3.25% 04/21/25	490,000.00	480,412.07	
	ACGB 3.25% 06/21/39	40,000.00	34,677.82	
	ACGB 3.75% 04/21/37	90,000.00	84,270.31	
	ACGB 3% 03/21/47	70,000.00	54,927.46	
	ACGB 3% 11/21/33	150,000.00	134,329.38	
	ACGB 4.25% 04/21/26	520,000.00	519,971.42	
	ACGB 4.75% 04/21/27	240,000.00	244,503.60	
オーストラリアドル 小計		4,760,000.00	4,227,355.85 (402,697,918)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	130,000.00	104,203.66	
	NZGB 1.5% 05/15/31	100,000.00	78,497.40	
	NZGB 1.75% 05/15/41	30,000.00	18,449.73	
	NZGB 2.75% 04/15/25	260,000.00	247,699.53	
	NZGB 2.75% 04/15/37	60,000.00	46,764.60	
	NZGB 2.75% 05/15/51	50,000.00	33,364.90	
	NZGB 3.5% 04/14/33	90,000.00	80,705.02	
	NZGB 3% 04/20/29	110,000.00	99,738.18	
	NZGB 4.25% 05/15/34	50,000.00	47,386.88	
	NZGB 4.5% 04/15/27	120,000.00	117,882.66	
ニュージーランドドル 小計		1,000,000.00	874,692.56 (77,314,075)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	150,000.00	140,055.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	60,000.00	51,228.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	160,000.00	154,320.00	

	SIGB 2.25% 08/01/36	70,000.00	63,560.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	90,000.00	87,981.75	
	SIGB 2.375% 07/01/39	10,000.00	9,235.50	
	SIGB 2.625% 08/01/32	60,000.00	58,084.45	
	SIGB 2.75% 03/01/46	40,000.00	40,176.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	80,000.00	79,940.80	
	SIGB 2.875% 07/01/29	80,000.00	78,560.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	110,000.00	107,800.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	40,000.00	40,660.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	100,000.00	100,650.00	
	SIGB 3% 08/01/72	20,000.00	22,426.00	
シンガポールドル 小計		1,070,000.00	1,034,677.50 (109,489,573)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	420,000.00	383,181.45	
	MGS 3.582% 07/15/32	200,000.00	194,832.22	
	MGS 3.733% 06/15/28	300,000.00	300,288.84	
	MGS 3.757% 05/22/40	300,000.00	284,381.54	
	MGS 3.828% 07/05/34	250,000.00	244,928.64	
	MGS 3.882% 03/14/25	350,000.00	352,569.42	
	MGS 3.885% 08/15/29	300,000.00	300,191.70	
	MGS 3.899% 11/16/27	450,000.00	453,803.35	
	MGS 3.9% 11/30/26	200,000.00	202,313.48	
	MGS 3.906% 07/15/26	300,000.00	303,154.50	
	MGS 3.955% 09/15/25	350,000.00	353,301.86	
	MGS 4.059% 09/30/24	220,000.00	221,453.32	
	MGS 4.232% 06/30/31	200,000.00	203,893.02	
	MGS 4.254% 05/31/35	480,000.00	487,465.39	
	MGS 4.457% 03/31/53	220,000.00	228,581.78	
	MGS 4.504% 04/30/29	250,000.00	258,155.65	
	MGS 4.696% 10/15/42	150,000.00	161,091.07	
	MGS 4.736% 03/15/46	240,000.00	256,691.42	
	MGS 4.762% 04/07/37	300,000.00	320,627.19	
	MGS 4.893% 06/08/38	130,000.00	142,096.95	
	MGS 4.921% 07/06/48	220,000.00	240,996.27	
マレーシアリンギット 小計		5,830,000.00	5,893,999.06 (180,324,543)	
タイバーツ	THAIGB 0.95% 06/17/25	2,600,000.00	2,541,380.32	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	3,000,000.00	2,972,755.20	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	1,500,000.00	1,325,070.15	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	2,000,000.00	1,905,360.40	
	THAIGB 1% 06/17/27	4,700,000.00	4,481,540.24	
	THAIGB 2.35% 06/17/26	2,500,000.00	2,513,529.75	
	THAIGB 2.65% 06/17/28	4,000,000.00	4,059,120.00	

	THAIGB 2.75% 06/17/52	700,000.00	634,682.09	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	2,000,000.00	1,926,421.18	
	THAIGB 2% 06/17/42	2,000,000.00	1,730,733.80	
	THAIGB 2% 12/17/31	5,000,000.00	4,842,856.45	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	1,000,000.00	1,050,631.40	
	THAIGB 3.35% 06/17/33	1,500,000.00	1,600,522.80	
	THAIGB 3.39% 06/17/37	3,400,000.00	3,613,064.40	
	THAIGB 3.45% 06/17/43	700,000.00	741,533.94	
	THAIGB 3.6% 06/17/67	3,700,000.00	3,623,901.06	
タイバーツ 小計		40,300,000.00	39,563,103.18 (160,626,198)	
インドネシアルピア	INDOGB 5.125% 04/15/27	5,300,000,000.00	5,203,752,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	3,000,000,000.00	3,025,740,000.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	3,000,000,000.00	3,058,560,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	2,000,000,000.00	2,021,200,000.00	
	INDOGB 6.875% 08/15/51	1,000,000,000.00	1,021,900,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	1,200,000,000.00	1,267,440,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	2,000,000,000.00	2,193,000,000.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	5,500,000,000.00	5,808,302,500.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	1,100,000,000.00	1,293,490,000.00	
インドネシアルピア 小計		24,100,000,000.00	24,893,384,500.00 (236,487,152)	
韓国ウォン	KTB 1.5% 03/10/25	900,000,000.00	866,902,482.00	
	KTB 1.5% 03/10/50	300,000,000.00	190,016,880.00	
	KTB 1.5% 09/10/40	200,000,000.00	143,972,488.00	
	KTB 1.875% 06/10/29	500,000,000.00	450,445,530.00	
	KTB 2.125% 03/10/47	200,000,000.00	150,977,822.00	
	KTB 2.25% 09/10/37	200,000,000.00	167,572,926.00	
	KTB 2.375% 03/10/27	500,000,000.00	476,758,600.00	
	KTB 2.5% 03/10/52	300,000,000.00	239,008,905.00	
	KTB 2.75% 12/10/44	200,000,000.00	172,050,736.00	
	KTB 2% 06/10/31	400,000,000.00	351,598,540.00	
	KTB 3.125% 06/10/26	800,000,000.00	786,680,120.00	
	KTB 3.25% 03/10/28	500,000,000.00	489,612,320.00	
	KTB 3.25% 03/10/53	500,000,000.00	458,751,555.00	
	KTB 3.25% 06/10/33	400,000,000.00	382,893,060.00	
	KTB 3.25% 09/10/42	200,000,000.00	187,294,512.00	
韓国ウォン 小計		6,100,000,000.00	5,514,536,476.00 (603,841,744)	
イスラエルシェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	120,000.00	109,619.01	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	200,000.00	186,685.48	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	100,000.00	81,197.12	

	ILGOV 1.5% 05/31/37	100,000.00	73,925.62	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	140,000.00	132,684.04	
	ILGOV 1% 03/31/30	120,000.00	100,083.94	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	150,000.00	139,208.22	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	40,000.00	30,556.79	
	ILGOV 2% 03/31/27	150,000.00	139,862.37	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	150,000.00	141,168.49	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	120,000.00	142,672.83	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	100,000.00	106,624.93	
イスラエルシェケル 小計		1,490,000.00	1,384,288.84 (53,397,142)	
オフショア人民元	CGB 1.99% 04/09/25	5,000,000.00	4,986,506.80	
	CGB 2.18% 08/25/25	5,000,000.00	4,999,268.90	
	CGB 2.26% 02/24/25	5,000,000.00	5,011,307.00	
	CGB 2.28% 11/25/25	5,000,000.00	5,007,607.00	
	CGB 2.37% 01/20/27	5,000,000.00	5,002,890.00	
	CGB 2.44% 10/15/27	3,000,000.00	3,004,431.30	
	CGB 2.5% 07/25/27	3,500,000.00	3,514,135.45	
	CGB 2.62% 09/25/29	3,000,000.00	3,003,249.90	
	CGB 2.68% 05/21/30	3,000,000.00	3,008,001.30	
	CGB 2.69% 08/12/26	5,000,000.00	5,061,676.50	
	CGB 2.69% 08/15/32	5,000,000.00	4,986,885.65	
	CGB 2.75% 02/17/32	3,000,000.00	3,006,687.60	
	CGB 2.8% 03/24/29	5,000,000.00	5,071,222.50	
	CGB 2.8% 11/15/32	5,000,000.00	5,035,347.50	
	CGB 2.88% 02/25/33	2,500,000.00	2,540,926.25	
	CGB 2.91% 10/14/28	4,400,000.00	4,494,115.56	
	CGB 2.94% 10/17/24	2,000,000.00	2,025,541.60	
	CGB 3.01% 05/13/28	1,600,000.00	1,644,828.80	
	CGB 3.02% 05/27/31	3,000,000.00	3,077,687.40	
	CGB 3.02% 10/22/25	2,500,000.00	2,548,046.75	
	CGB 3.12% 10/25/52	1,000,000.00	1,013,557.10	
	CGB 3.13% 11/21/29	3,100,000.00	3,204,441.79	
	CGB 3.27% 03/25/73	1,000,000.00	1,034,127.90	
	CGB 3.27% 11/19/30	3,000,000.00	3,144,122.40	
	CGB 3.28% 12/03/27	5,000,000.00	5,195,845.00	
	CGB 3.32% 04/15/52	1,000,000.00	1,044,957.70	
	CGB 3.39% 03/16/50	2,000,000.00	2,112,947.40	
	CGB 3.4% 07/15/72	1,000,000.00	1,066,706.60	
	CGB 3.53% 10/18/51	2,000,000.00	2,168,542.80	
	CGB 3.72% 04/12/51	2,000,000.00	2,238,479.80	
	CGB 3.73% 05/25/70	1,000,000.00	1,147,325.50	
	CGB 3.76% 03/22/71	1,000,000.00	1,152,867.30	

		CGB 3.81% 09/14/50	2,000,000.00	2,270,217.60	
		CGB 3.82% 11/19/68	1,000,000.00	1,162,144.40	
		CGB 3.86% 07/22/49	2,500,000.00	2,850,033.00	
		CGB 4.08% 10/22/48	900,000.00	1,061,531.73	
		CGB 4% 06/24/69	1,000,000.00	1,211,935.80	
	オフショア人民元 小計		107,000,000.00	110,110,147.58 (2,169,720,458)	
国債証券合計				21,342,210,861 (21,342,210,861)	
地方債証券	アメリカドル	ALTA 1.3% 07/22/30	200,000.00	160,337.34	
		BRCOL 0.9% 07/20/26	100,000.00	88,938.62	
		BRCOL 1.3% 01/29/31	100,000.00	79,704.68	
		CADEPO 0.875% 06/10/25	250,000.00	229,999.78	
		MP 1.5% 10/25/28	200,000.00	170,817.84	
		NBRNS 3.625% 02/24/28	100,000.00	95,067.28	
		ONT 1.6% 02/25/31	200,000.00	162,445.34	
		ONT 1.8% 10/14/31	200,000.00	163,362.38	
		ONT 2.125% 01/21/32	400,000.00	333,743.96	
		Q 1.35% 05/28/30	100,000.00	81,032.73	
		Q 1.9% 04/21/31	300,000.00	248,630.35	
		SCDA 3.25% 06/08/27	100,000.00	94,206.59	
	アメリカドル 小計		2,250,000.00	1,908,286.89 (272,007,213)	
	カナダドル	ALTA 1.65% 06/01/31	100,000.00	82,468.35	
		ALTA 2.9% 09/20/29	100,000.00	92,525.12	
		ALTA 2.95% 06/01/52	100,000.00	77,478.21	
		BRCOL 1.55% 06/18/31	100,000.00	81,903.79	
		BRCOL 2.95% 12/18/28	100,000.00	93,566.82	
		BRCOL 3.2% 06/18/44	100,000.00	83,873.24	
		MP 2.85% 09/05/46	100,000.00	76,479.14	
		MP 6.3% 03/05/31	100,000.00	112,746.23	
		NBRNS 5.5% 01/27/34	100,000.00	109,415.07	
		NF 1.25% 06/02/27	100,000.00	88,331.14	
		NF 2.65% 10/17/50	100,000.00	68,945.60	
		NS 4.4% 06/01/42	100,000.00	98,797.62	
		ONT 1.35% 09/08/26	100,000.00	90,525.44	
		ONT 1.55% 11/01/29	100,000.00	85,139.04	
		ONT 2.55% 12/02/52	100,000.00	71,619.65	
		ONT 2.6% 06/02/27	200,000.00	186,886.95	
		ONT 2.65% 02/05/25	200,000.00	192,857.68	
		ONT 2.65% 12/02/50	100,000.00	73,768.76	
		ONT 2.8% 06/02/48	200,000.00	153,633.59	

		ONT 3.45% 06/02/45	200,000.00	174,038.96	
		ONT 3.65% 06/02/33	100,000.00	95,146.65	
		ONT 3.75% 06/02/32	100,000.00	96,123.38	
		ONT 4.65% 06/02/41	200,000.00	206,098.14	
		ONT 6.2% 06/02/31	100,000.00	112,789.93	
		ONT 6.5% 03/08/29	100,000.00	111,085.85	
		ONT 8% 06/02/26	200,000.00	217,890.54	
		Q 1.9% 09/01/30	100,000.00	85,617.53	
		Q 2.75% 09/01/25	200,000.00	191,458.34	
		Q 3.1% 12/01/51	100,000.00	81,140.06	
		Q 3.25% 09/01/32	200,000.00	184,804.35	
		Q 3.5% 12/01/45	100,000.00	87,616.71	
		Q 3.6% 09/01/33	100,000.00	94,739.11	
		Q 3.65% 05/20/32	100,000.00	95,735.38	
		Q 4.4% 12/01/55	200,000.00	206,775.68	
		Q 6% 10/01/29	100,000.00	109,345.84	
		SCDA 3.75% 03/05/54	100,000.00	90,588.44	
		SCDA 4.75% 06/01/40	100,000.00	103,156.91	
	カナダドル 小計		4,600,000.00	4,265,113.24 (457,646,650)	
	ユーロ	ALTA 0.625% 01/16/26	100,000.00	92,774.00	
		BAYERN 0.01% 05/07/29	100,000.00	82,873.40	
		BAYERN 0.03% 04/03/28	100,000.00	85,650.80	
		BERGER 0.01% 07/02/30	100,000.00	79,773.12	
		BERGER 0.625% 01/26/52	100,000.00	50,449.00	
		BERGER 0.625% 07/15/39	100,000.00	65,840.60	
		HESLAN 2.375% 09/21/26	100,000.00	96,313.60	
		HESLAN 4% 02/04/30	100,000.00	97,530.80	
		HESSEN 0% 06/10/26	100,000.00	90,361.90	
		HESSEN 1.3% 10/10/33	100,000.00	83,081.40	
		KOMINS 0.875% 09/01/29	100,000.00	86,636.30	
		KOMINS 3.375% 03/15/27	100,000.00	99,769.00	
		KOMMUN 0% 11/17/29	100,000.00	81,064.00	
		LANDER 0.01% 02/04/31	100,000.00	78,415.80	
		MADRID 3.596% 04/30/33	100,000.00	98,144.04	
		NIESA 0.05% 03/09/35	100,000.00	68,589.30	
		NIESA 0% 02/11/27	100,000.00	88,479.80	
		NIESA 0% 09/15/25	100,000.00	92,534.20	
		NRW 0.25% 03/13/26	200,000.00	183,324.00	
		NRW 0.6% 06/04/41	100,000.00	62,094.70	
		NRW 0% 05/05/25	100,000.00	93,636.70	
		NRW 1.65% 05/16/47	100,000.00	71,847.90	
		NRW 3.4% 03/07/2073	100,000.00	99,856.90	

		ONT 0.01% 11/25/30	100,000.00	77,211.40	
		ONT 0.25% 06/09/31	100,000.00	77,145.00	
		Q 0.875% 05/04/27	100,000.00	90,222.80	
		Q 1.125% 10/28/25	100,000.00	94,199.80	
		SACHAN 0.125% 06/21/29	100,000.00	83,073.22	
	ユーロ 小計		2,900,000.00	2,450,893.48 (383,074,650)	
	オーストラリアドル	NSWTC 1.25% 03/20/25	100,000.00	94,437.10	
		NSWTC 1.5% 02/20/32	100,000.00	76,298.71	
		NSWTC 2.25% 05/07/41	100,000.00	64,221.30	
		NSWTC 2% 03/08/33	100,000.00	77,174.09	
		NSWTC 3% 04/20/29	100,000.00	91,827.98	
		NSWTC 3% 05/20/27	100,000.00	94,660.12	
		NSWTC 3% 11/15/28	100,000.00	92,550.88	
		NSWTC 4.75% 02/20/35	200,000.00	192,946.40	
		QTC 1.5% 03/02/32	100,000.00	76,801.10	
		QTC 1.75% 07/20/34	100,000.00	72,522.16	
		QTC 2.25% 10/28/50	100,000.00	56,075.78	
		QTC 3.25% 07/21/28	200,000.00	188,470.70	
		QTC 4.5% 03/09/33	100,000.00	97,237.35	
		QTC 4.75% 07/21/25	100,000.00	100,157.18	
		TCV 0.5% 11/20/25	200,000.00	181,676.78	
		TCV 1.25% 11/19/27	100,000.00	86,981.18	
		TCV 1.5% 09/10/31	100,000.00	77,459.08	
		TCV 2.5% 10/22/29	100,000.00	88,163.67	
		TCV 2% 11/20/37	100,000.00	66,214.26	
		WATC 1.5% 10/22/30	100,000.00	80,625.96	
		WATC 3% 10/21/26	100,000.00	95,432.95	
	オーストラリアドル 小計		2,400,000.00	2,051,934.73 (195,467,302)	
地方債証券合計				1,308,195,815 (1,308,195,815)	
特殊債券	**アメリカドル**	AFDB 0.875% 07/22/26	100,000.00	89,093.50	
		AFDB 4.375% 03/14/28	100,000.00	99,354.12	
		AGFRNC 4.5% 02/17/26	200,000.00	197,275.95	
		AIIB 0.5% 01/27/26	100,000.00	89,211.60	
		ASIA 1.75% 09/19/29	100,000.00	85,917.86	
		ASIA 1% 04/14/26	100,000.00	90,308.31	
		ASIA 3.875% 09/28/32	100,000.00	97,156.97	
		ASIA 4% 01/12/33	100,000.00	98,023.83	
		CADES 1.125% 11/29/24	200,000.00	188,469.70	
		CAF 4.75% 04/01/26	100,000.00	97,561.66	

		CM 3.3% 04/07/25	100,000.00	96,109.19	
		COE 3.625% 01/26/28	100,000.00	96,350.61	
		COE 3% 06/16/25	100,000.00	96,080.91	
		DBJJP 4.375% 09/22/25	200,000.00	196,280.84	
		EBRD 4.375% 03/09/28	100,000.00	99,498.10	
		EDC 3.375% 08/26/25	200,000.00	193,724.61	
		EIB 0.375% 03/26/26	200,000.00	177,916.33	
		EIB 1.75% 03/15/29	100,000.00	86,678.26	
		EIBKOR 1.25% 09/21/30	200,000.00	157,657.24	
		EIBKOR 5% 01/11/28	200,000.00	199,321.28	
		FHLB 0.96% 03/05/26	200,000.00	180,475.56	
		FHLMC 5.68% 04/03/25	200,000.00	199,021.80	
		FNMA 1.875% 09/24/26	100,000.00	91,758.75	
		FNMA 5.625% 07/15/37	200,000.00	224,671.71	
		FNMA 7.125% 01/15/30	200,000.00	231,808.71	
		IADB 0.875% 04/20/26	100,000.00	89,899.58	
		IADB 1.125% 01/13/31	100,000.00	79,518.42	
		IADB 3.5% 09/14/29	100,000.00	95,351.26	
		IBRD 0.875% 07/15/26	100,000.00	89,231.33	
		IBRD 1.375% 04/20/28	100,000.00	86,747.83	
		IBRD 3.5% 07/12/28	100,000.00	95,615.11	
		IDBINV 4.125% 02/15/28	100,000.00	97,524.06	
		IFC 0.75% 08/27/30	100,000.00	78,124.67	
		IFC 3.625% 09/15/25	100,000.00	97,370.87	
		JBIC 2.75% 01/21/26	200,000.00	188,874.10	
		JBIC 4.25% 01/26/26	200,000.00	195,923.90	
		JBIC 4.375% 10/05/27	200,000.00	196,758.01	
		JICA 3.25% 05/25/27	200,000.00	187,081.04	
		KBN 4.625% 10/24/25	200,000.00	198,626.51	
		KBN 4% 01/19/28	200,000.00	195,139.07	
		KDB 4.25% 09/08/32	200,000.00	190,061.35	
		KFW 0.75% 09/30/30	100,000.00	78,274.76	
		KFW 3.625% 04/01/26	100,000.00	97,094.38	
		KFW 3.75% 02/15/28	200,000.00	193,807.78	
		LBANK 1.375% 10/12/28	100,000.00	85,207.10	
		NEDFIN 4.375% 04/04/25	200,000.00	196,719.55	
		NEDWBK 1% 05/28/30	200,000.00	158,894.70	
		NIB 2.625% 04/04/25	200,000.00	191,635.48	
		OKB 4.125% 01/20/26	100,000.00	98,163.21	
		SDBC 2% 02/16/27	200,000.00	182,036.77	
		SEK 2.25% 03/22/27	200,000.00	182,683.50	
		TVA 3.875% 03/15/28	200,000.00	195,082.36	

	TVA 4.25% 09/15/65	100,000.00	88,880.28	
	TVA 7.125% 05/01/30	200,000.00	228,849.42	
アメリカドル 小計		8,000,000.00	7,598,903.80 (1,083,147,747)	
カナダドル	ASIA 0.75% 02/10/26	100,000.00	90,237.46	
	ASIA 1.5% 05/04/28	100,000.00	88,032.04	
	CANHOU 0.95% 06/15/25	100,000.00	92,769.35	
	CANHOU 1.1% 03/15/31	200,000.00	161,140.94	
	CANHOU 1.25% 06/15/26	100,000.00	91,045.68	
	CANHOU 1.95% 12/15/25	200,000.00	187,282.85	
	CANHOU 2.15% 12/15/31	100,000.00	86,647.11	
	CANHOU 2.65% 12/15/28	100,000.00	92,498.01	
	CANHOU 3.1% 06/15/28	100,000.00	95,011.98	
	CANHOU 3.65% 06/15/33	100,000.00	97,165.79	
	CANHOU 3.8% 06/15/27	100,000.00	98,034.70	
	KFW 0.75% 02/19/26	100,000.00	90,225.88	
	QHEL 4% 02/15/55	100,000.00	95,669.55	
	QHEL 4% 02/15/63	100,000.00	95,821.57	
カナダドル 小計		1,600,000.00	1,461,582.91 (156,827,846)	
ユーロ	AFDB 0.5% 03/22/27	100,000.00	89,751.40	
	AGFRNC 0.125% 09/29/31	100,000.00	76,240.50	
	AGFRNC 3.75% 02/15/27	100,000.00	100,530.40	
	ASFING 0.125% 06/02/31	100,000.00	78,479.10	
	ASIA 0.025% 01/31/30	100,000.00	80,898.97	
	BNG 0.125% 07/09/35	100,000.00	68,294.50	
	BNG 0.75% 01/24/29	100,000.00	86,798.50	
	BNG 1.25% 03/30/37	100,000.00	76,100.00	
	BNG 2.75% 10/04/27	100,000.00	97,552.24	
	BNG 3% 04/23/30	100,000.00	97,844.70	
	CADES 0% 02/25/26	300,000.00	273,994.80	
	CADES 0% 05/25/29	100,000.00	82,525.30	
	CADES 0% 05/25/31	100,000.00	77,390.80	
	CADES 2.75% 11/25/32	100,000.00	95,285.20	
	CADES 2.875% 05/25/27	100,000.00	98,020.50	
	CADES 3.125% 03/01/30	100,000.00	98,830.40	
	COE 0.25% 01/19/32	100,000.00	77,777.70	
	DBHNGR 1.875% 05/24/30	100,000.00	90,120.00	
	EDF 3.875% 01/12/27	100,000.00	98,702.50	
	EDF 4.625% 01/25/43	100,000.00	93,506.85	
	EFSF 0.05% 10/17/29	100,000.00	81,963.90	
	EFSF 0.7% 01/17/53	200,000.00	99,373.80	
	EFSF 0.875% 09/05/28	100,000.00	88,572.57	

		EFSF 0% 01/20/31	100,000.00	78,459.56	
		EFSF 0% 10/15/25	100,000.00	92,466.40	
		EFSF 1.5% 12/15/25	100,000.00	95,416.30	
		EFSF 2.875% 02/16/33	200,000.00	193,338.00	
		EFSF 3% 09/04/34	42,000.00	40,620.42	
		EIB 0.05% 10/13/34	100,000.00	69,641.80	
		EIB 0.05% 11/15/29	100,000.00	82,008.67	
		EIB 0.125% 04/15/25	100,000.00	94,212.50	
		EIB 0.2% 03/17/36	100,000.00	67,526.36	
		EIB 0.25% 01/20/32	100,000.00	77,934.70	
		EIB 0.25% 06/15/40	100,000.00	59,536.76	
		EIB 0.375% 09/15/27	100,000.00	88,686.30	
		EIB 0.625% 01/22/29	100,000.00	86,775.00	
		EIB 0% 03/13/26	100,000.00	91,369.40	
		EIB 0% 03/25/25	100,000.00	94,133.30	
		EIB 0% 05/15/28	200,000.00	170,793.00	
		EIB 0% 06/17/27	100,000.00	87,858.30	
		EIB 0% 09/09/30	100,000.00	79,590.10	
		EIB 2.75% 07/28/28	100,000.00	97,645.08	
		EIB 3.625% 03/14/42	100,000.00	101,665.90	
		EIBKOR 1.375% 11/24/25	100,000.00	94,220.10	
		ESM 0.01% 10/15/31	100,000.00	76,848.60	
		ESM 3% 03/15/28	200,000.00	197,346.80	
		EU 0.25% 04/22/36	100,000.00	68,070.25	
		EU 0.4% 02/04/37	100,000.00	67,971.20	
		EU 0.7% 07/06/51	100,000.00	53,350.19	
		EU 0.75% 01/04/47	100,000.00	58,325.20	
		EU 0.8% 07/04/25	100,000.00	94,852.20	
		EU 0% 03/04/26	300,000.00	274,838.70	
		EU 0% 07/04/31	100,000.00	77,647.00	
		EU 0% 07/04/35	100,000.00	67,223.40	
		EU 0% 07/06/26	100,000.00	90,617.60	
		EU 0% 10/04/30	100,000.00	79,557.40	
		EU 0% 11/04/25	100,000.00	92,536.40	
		EU 1.625% 12/04/29	100,000.00	90,652.50	
		EU 1% 07/06/32	100,000.00	82,883.00	
		EU 2.5% 10/04/52	100,000.00	82,913.83	
		EU 2.625% 02/04/48	100,000.00	87,477.00	
		EU 2% 10/04/27	100,000.00	94,859.20	
		EU 3.375% 11/04/42	100,000.00	98,479.50	
		EUROF 0.01% 06/23/28	100,000.00	84,100.50	
		IBRD 0.1% 09/17/35	100,000.00	67,621.50	
		IBRD 0.5% 04/16/30	100,000.00	83,125.60	

	IBRD 0.7% 10/22/46	100,000.00	57,325.12	
	IBRD 0% 01/15/27	100,000.00	88,679.60	
	IBRD 2.9% 01/19/33	100,000.00	96,503.10	
	IDAWBG 0.7% 01/17/42	100,000.00	62,560.93	
	IDAWBG 1.75% 05/05/37	100,000.00	82,049.04	
	KFW 0.125% 01/09/32	100,000.00	77,607.40	
	KFW 0.125% 06/30/25	200,000.00	187,424.20	
	KFW 0.375% 05/20/36	100,000.00	69,681.15	
	KFW 0% 02/18/25	200,000.00	189,122.80	
	KFW 0% 03/31/27	100,000.00	88,449.40	
	KFW 0% 09/30/26	100,000.00	89,894.20	
	KFW 2.5% 11/19/25	200,000.00	195,961.70	
	KFW 2.75% 02/14/33	100,000.00	96,602.70	
	KFW 2.75% 03/15/28	100,000.00	97,910.70	
	KFW 2% 11/15/29	100,000.00	93,214.10	
	LBANK 0.375% 02/25/27	100,000.00	89,519.59	
	NEDWBK 0.5% 04/26/51	100,000.00	48,162.20	
	NEDWBK 0.75% 10/04/41	100,000.00	63,322.73	
	NRWBK 0.1% 07/09/35	100,000.00	67,807.87	
	NRWBK 0% 05/14/29	100,000.00	82,477.20	
	OKB 1.5% 07/13/27	100,000.00	92,827.70	
	POSIM 0% 12/10/24	100,000.00	94,120.51	
	RENTEN 0.01% 11/26/40	100,000.00	56,548.00	
	RENTEN 0.1% 03/08/27	100,000.00	88,844.40	
	RENTEN 0% 12/13/28	100,000.00	83,900.40	
	RENTEN 3% 11/14/34	100,000.00	97,440.40	
	RESFER 2.25% 12/20/47	100,000.00	74,000.20	
	RESFER 2.625% 12/29/25	100,000.00	97,708.50	
	RESFER 3.125% 10/25/28	100,000.00	98,351.30	
	SBAB 1.875% 12/10/25	100,000.00	94,942.90	
	SEK 3.25% 04/13/26	100,000.00	98,736.56	
	SNCF 1% 01/19/61	100,000.00	40,092.00	
ユーロ 小計		10,842,000.00	9,165,538.75 (1,432,573,706)	
イギリスポンド	AIIB 1.125% 09/15/26	100,000.00	86,148.80	
	COE 4.25% 03/16/26	100,000.00	95,808.21	
	EIB 5.625% 06/07/32	100,000.00	105,253.70	
	IADB 2.125% 12/15/28	100,000.00	85,062.90	
	KFW 1.125% 07/04/25	100,000.00	91,101.40	
	KFW 3.75% 07/30/27	100,000.00	93,460.08	
	RENTEN 2.125% 12/15/28	100,000.00	84,798.90	
イギリスポンド 小計		700,000.00	641,633.99	

			(117,303,526)	
オーストラリアドル	ASIA 4.25% 01/17/28	100,000.00	97,483.59	
	BNG 1.6% 11/27/30	100,000.00	77,305.11	
	EDC 4.5% 09/06/28	100,000.00	98,291.77	
	IBRD 3% 10/19/26	100,000.00	94,542.55	
	LBANK 4.25% 08/07/25	100,000.00	98,223.32	
	NIB 2.4% 09/22/25	100,000.00	94,764.06	
	RENTEN 2.6% 03/23/27	100,000.00	92,470.63	
オーストラリアドル 小計		700,000.00	653,081.03 (62,212,498)	
オフショア人民元	ADBCH 2.46% 07/27/25	3,000,000.00	3,007,410.90	
	ADBCH 2.58% 03/23/25	4,000,000.00	4,016,959.20	
	ADBCH 2.6% 12/01/25	3,000,000.00	3,015,842.40	
	ADBCH 2.74% 02/23/27	2,000,000.00	2,015,257.00	
	ADBCH 2.83% 08/11/29	2,000,000.00	2,011,099.80	
	ADBCH 2.9% 03/08/28	2,000,000.00	2,026,050.00	
	ADBCH 2.91% 02/21/29	2,000,000.00	2,019,716.20	
	ADBCH 2.97% 10/14/32	2,000,000.00	2,015,926.80	
	ADBCH 3.01% 03/16/30	1,500,000.00	1,523,495.85	
	ADBCH 3.19% 08/12/28	2,000,000.00	2,050,235.60	
	ADBCH 3.3% 11/05/31	2,000,000.00	2,066,404.40	
	ADBCH 3.35% 03/24/26	3,000,000.00	3,073,408.80	
	ADBCH 3.52% 05/24/31	2,000,000.00	2,098,188.80	
	ADBCH 3.79% 10/26/30	2,000,000.00	2,131,763.40	
	ADBCH 3.92% 06/18/51	1,000,000.00	1,146,011.60	
	ADBCH 3.95% 02/26/36	1,000,000.00	1,101,763.00	
	EXIMCH 2.57% 06/10/25	2,000,000.00	2,009,266.20	
	EXIMCH 2.61% 01/27/27	2,000,000.00	2,006,201.40	
	EXIMCH 2.82% 06/17/27	2,000,000.00	2,018,975.20	
	EXIMCH 2.87% 02/06/28	2,000,000.00	2,023,052.40	
	EXIMCH 2.93% 03/02/25	2,000,000.00	2,020,358.80	
	EXIMCH 3.1% 02/13/33	2,000,000.00	2,035,848.00	
	EXIMCH 3.22% 05/14/26	3,000,000.00	3,067,008.30	
	EXIMCH 3.23% 03/23/30	2,000,000.00	2,057,059.40	
	EXIMCH 3.38% 07/16/31	2,000,000.00	2,079,118.40	
	EXIMCH 3.43% 10/23/25	2,000,000.00	2,046,376.40	
	EXIMCH 3.88% 01/12/36	1,000,000.00	1,095,010.50	
	EXIMCH 3.99% 02/09/25	1,000,000.00	1,026,335.50	
	SDBC 2.22% 08/25/25	3,000,000.00	2,994,218.37	
	SDBC 2.59% 01/11/26	3,000,000.00	3,017,851.50	
	SDBC 2.59% 03/17/25	5,000,000.00	5,027,547.50	
	SDBC 2.65% 02/24/27	3,000,000.00	3,016,419.90	
	SDBC 2.69% 06/16/27	3,000,000.00	3,017,597.70	

		SDBC 2.73% 01/11/28	3,000,000.00	3,025,776.60	
		SDBC 2.83% 09/10/26	3,000,000.00	3,035,925.90	
		SDBC 2.96% 07/18/32	2,000,000.00	2,014,632.60	
		SDBC 2.98% 04/22/32	2,000,000.00	2,017,419.40	
		SDBC 2.99% 03/01/29	2,000,000.00	2,029,448.20	
		SDBC 3.02% 03/06/33	2,000,000.00	2,031,680.00	
		SDBC 3.07% 03/10/30	2,000,000.00	2,038,426.40	
		SDBC 3.09% 06/18/30	2,000,000.00	2,041,470.60	
		SDBC 3.12% 09/13/31	2,000,000.00	2,040,940.00	
		SDBC 3.23% 01/10/25	5,000,000.00	5,072,758.50	
		SDBC 3.34% 07/14/25	3,000,000.00	3,060,831.90	
		SDBC 3.43% 01/14/27	3,000,000.00	3,095,028.60	
		SDBC 3.45% 09/20/29	2,000,000.00	2,081,655.40	
		SDBC 3.49% 11/08/41	2,000,000.00	2,101,988.60	
		SDBC 3.5% 11/04/46	1,000,000.00	1,068,230.90	
		SDBC 3.66% 03/01/31	2,000,000.00	2,118,721.60	
		SDBC 4.04% 07/06/28	2,000,000.00	2,132,880.20	
	オフショア人民元 小計		114,500,000.00	116,885,594.62 (2,303,230,641)	
特殊債券合計				5,155,295,964 (5,155,295,964)	
社債券	**アメリカドル**	AAPL 0.7% 02/08/26	100,000.00	89,864.57	
		AAPL 1.4% 08/05/28	100,000.00	85,450.03	
		AAPL 2.65% 05/11/50	100,000.00	67,334.42	
		AAPL 3.35% 08/08/32	100,000.00	91,637.29	
		AAPL 3.75% 11/13/47	100,000.00	83,596.39	
		ABBV 2.6% 11/21/24	100,000.00	96,119.89	
		ABBV 4.45% 05/14/46	100,000.00	86,167.88	
		ABC 2.7% 03/15/31	100,000.00	83,758.62	
		ABIBB 4.7% 02/01/36	100,000.00	95,061.69	
		ABIBB 4.9% 02/01/46	100,000.00	92,748.22	
		ABIBB 5.8% 01/23/59	100,000.00	105,354.75	
		ABNANV 3.324% 03/13/37	200,000.00	149,390.37	
		ABT 1.15% 01/30/28	100,000.00	85,783.59	
		ACAFP 1.907% 06/16/26	250,000.00	230,709.21	
		AEE 3.9% 04/01/52	100,000.00	79,147.33	
		AER 2.45% 10/29/26	150,000.00	133,644.63	
		AER 3.85% 10/29/41	150,000.00	112,199.29	
		AES 1.375% 01/15/26	100,000.00	89,242.51	
		AIG 2.5% 06/30/25	100,000.00	94,287.67	
		AL 2.875% 01/15/26	100,000.00	92,472.95	
		AMGN 3.15% 02/21/40	100,000.00	74,646.68	

		AMGN 5.15% 03/02/28	100,000.00	99,111.05	
		AMGN 5.6% 03/02/43	100,000.00	97,994.88	
		AMGN 5.75% 03/02/63	100,000.00	98,308.99	
		AMT 3.8% 08/15/29	100,000.00	90,449.62	
		AMZN 3.875% 08/22/37	100,000.00	88,899.43	
		AMZN 3% 04/13/25	100,000.00	96,536.87	
		AMZN 4.25% 08/22/57	100,000.00	87,114.78	
		AMZN 4.55% 12/01/27	100,000.00	98,711.69	
		AON 3.875% 12/15/25	100,000.00	96,426.30	
		APD 2.7% 05/15/40	100,000.00	72,826.76	
		APH 4.75% 03/30/26	100,000.00	98,580.74	
		ARE 4.75% 04/15/35	100,000.00	90,484.64	
		ATH 3.95% 05/25/51	100,000.00	65,780.94	
		ATH 6.15% 04/03/30	100,000.00	99,872.11	
		ATO 5.75% 10/15/52	100,000.00	103,486.68	
		ATVI 1.35% 09/15/30	100,000.00	78,905.67	
		AVB 1.9% 12/01/28	100,000.00	83,673.40	
		AVGO 1.95% 02/15/28	100,000.00	85,796.21	
		AVGO 4.15% 04/15/32	100,000.00	89,122.02	
		AXP 2.25% 03/04/25	100,000.00	94,910.97	
		AZN 0.7% 04/08/26	100,000.00	88,941.38	
		AZO 4% 04/15/30	100,000.00	91,655.56	
		BA 2.196% 02/04/26	100,000.00	91,676.33	
		BA 3.25% 02/01/28	100,000.00	90,821.26	
		BA 5.15% 05/01/30	100,000.00	97,475.87	
		BABA 2.125% 02/09/31	200,000.00	159,454.24	
		BAC 1.734% 07/22/27	100,000.00	88,829.72	
		BAC 1.898% 07/23/31	100,000.00	78,224.09	
		BAC 2.087% 06/14/29	100,000.00	84,420.40	
		BAC 2.572% 10/20/32	100,000.00	79,795.82	
		BAC 3.366% 01/23/26	200,000.00	192,011.65	
		BAC 3.483% 03/13/52	100,000.00	72,119.23	
		BAC 3.5% 04/19/26	100,000.00	95,528.27	
		BAC 4.083% 03/20/51	100,000.00	80,152.08	
		BAC 4.827% 07/22/26	200,000.00	196,351.35	
		BACR 5.088% 06/20/30	200,000.00	180,173.73	
		BACR 7.385% 11/02/28	200,000.00	207,353.45	
		BATSLN 4.54% 08/15/47	100,000.00	72,202.25	
		BAX 1.915% 02/01/27	100,000.00	88,262.12	
		BAYNGR 4.7% 07/15/64	100,000.00	77,790.45	
		BCECN 2.15% 02/15/32	100,000.00	78,888.69	
		BDX 4.298% 08/22/32	100,000.00	93,176.93	

		BFCM 4.935% 01/26/26	200,000.00	195,504.04	
		BHF 5.625% 05/15/30	100,000.00	96,232.46	
		BHI 4.08% 12/15/47	100,000.00	78,636.10	
		BHP 4.75% 02/28/28	100,000.00	98,750.10	
		BK 4.414% 07/24/26	100,000.00	97,801.75	
		BK 4.596% 07/26/30	100,000.00	95,155.47	
		BK 5.834% 10/25/33	100,000.00	102,251.31	
		BMO 4.7% 09/14/27	100,000.00	96,871.19	
		BMY 0.75% 11/13/25	100,000.00	90,838.97	
		BMY 2.95% 03/15/32	100,000.00	86,505.90	
		BNP 2.159% 09/15/29	200,000.00	165,126.45	
		BNS 4.588% 05/04/37	100,000.00	84,552.89	
		BNSF 2.875% 06/15/52	100,000.00	66,275.05	
		BOCAVI 3.25% 04/29/25	200,000.00	190,650.24	
		BPCEGP 3.116% 10/19/32	250,000.00	190,098.01	
		BPLN 3.001% 03/17/52	100,000.00	66,752.76	
		BPLN 3.06% 06/17/41	100,000.00	73,597.52	
		BRK 2.3% 03/15/27	100,000.00	92,851.47	
		BRKHEC 2.85% 05/15/51	100,000.00	63,196.84	
		BRKHEC 3.7% 07/15/30	100,000.00	90,647.95	
		BRKHEC 4.45% 01/15/49	100,000.00	82,211.05	
		BSX 1.9% 06/01/25	100,000.00	93,787.46	
		BXP 3.4% 06/21/29	100,000.00	83,643.35	
		C 1.122% 01/28/27	100,000.00	88,807.07	
		C 1.462% 06/09/27	100,000.00	88,241.91	
		C 2.904% 11/03/42	100,000.00	68,554.27	
		C 3.668% 07/24/28	100,000.00	92,686.43	
		C 4.75% 05/18/46	100,000.00	83,400.80	
		C 5.61% 09/29/26	100,000.00	99,707.35	
		CAG 1.375% 11/01/27	100,000.00	84,023.70	
		CARR 2.242% 02/15/25	100,000.00	94,707.79	
		CAT 4.9% 01/17/25	100,000.00	99,659.01	
		CB 1.375% 09/15/30	100,000.00	78,295.87	
		CBAAU 3.305% 03/11/41	200,000.00	136,210.50	
		CCI 1.05% 07/15/26	100,000.00	87,522.42	
		CEG 3.25% 06/01/25	100,000.00	95,287.03	
		CHTR 2.25% 01/15/29	100,000.00	82,383.65	
		CHTR 4.4% 04/01/33	100,000.00	86,002.86	
		CHTR 5.75% 04/01/48	100,000.00	83,615.13	
		CI 4.8% 07/15/46	100,000.00	88,835.10	
		CL 4.8% 03/02/26	100,000.00	100,253.69	
		CM 3.6% 04/07/32	100,000.00	88,213.16	
		CMCSA 2.65% 02/01/30	100,000.00	86,172.15	

		CMCSA 2.8% 01/15/51	100,000.00	63,769.95	
		CMCSA 3.25% 11/01/39	100,000.00	77,303.16	
		CMCSA 5.25% 11/07/25	100,000.00	100,461.88	
		CMCSA 5.35% 05/15/53	100,000.00	98,208.94	
		CME 4.15% 06/15/48	100,000.00	88,568.46	
		CNC 2.45% 07/15/28	100,000.00	84,723.29	
		CNC 4.625% 12/15/29	100,000.00	91,532.00	
		CNP 1.45% 06/01/26	100,000.00	89,109.95	
		CNQCN 2.95% 07/15/30	100,000.00	84,659.85	
		COF 3.273% 03/01/30	100,000.00	84,512.91	
		COP 3.8% 03/15/52	100,000.00	78,806.04	
		COP 4.875% 10/01/47	100,000.00	93,377.58	
		COST 1.375% 06/20/27	100,000.00	87,718.94	
		CPB 2.375% 04/24/30	100,000.00	82,926.64	
		CPPIBC 3.25% 06/15/27	250,000.00	236,344.53	
		CRM 1.5% 07/15/28	100,000.00	85,245.46	
		CSCO 2.5% 09/20/26	100,000.00	93,274.77	
		CSX 4.1% 11/15/32	100,000.00	93,331.02	
		CVECN 2.65% 01/15/32	100,000.00	79,349.08	
		CVS 4.78% 03/25/38	100,000.00	90,088.53	
		CVS 5.125% 07/20/45	100,000.00	90,201.25	
		CVS 6% 06/01/63	100,000.00	99,554.25	
		CVX 1.554% 05/11/25	100,000.00	93,750.15	
		D 3.3% 04/15/41	100,000.00	72,531.88	
		DAL 7% 05/01/25	100,000.00	102,078.95	
		DANBNK 4.298% 04/01/28	200,000.00	185,499.81	
		DB 4.875% 12/01/32	200,000.00	168,066.31	
		DB 6.119% 07/14/26	150,000.00	148,399.05	
		DD 4.725% 11/15/28	100,000.00	97,632.18	
		DE 0.7% 01/15/26	100,000.00	89,719.73	
		DE 3.1% 04/15/30	100,000.00	89,873.74	
		DELL 3.45% 12/15/51	100,000.00	64,900.35	
		DG 4.125% 04/03/50	100,000.00	76,632.20	
		DGELN 5.2% 10/24/25	200,000.00	200,390.26	
		DIS 3.6% 01/13/51	100,000.00	76,923.53	
		DIS 3.7% 03/23/27	100,000.00	96,031.59	
		DIS 6.2% 12/15/34	100,000.00	107,609.09	
		DOW 3.6% 11/15/50	100,000.00	71,662.72	
		DT 4.375% 06/21/28	150,000.00	144,875.47	
		DTE 3% 03/01/32	100,000.00	84,868.18	
		DUK 3.25% 08/15/25	100,000.00	95,947.54	
		DUK 3.7% 09/01/28	100,000.00	93,511.67	

		DUK 5.25% 03/15/33	100,000.00	99,718.31	
		DUK 5.25% 04/01/33	100,000.00	99,423.06	
		DUK 5.35% 01/15/53	200,000.00	195,720.82	
		DUK 5% 08/15/52	100,000.00	88,922.18	
		DVN 4.5% 01/15/30	100,000.00	93,323.27	
		EBAY 1.4% 05/10/26	100,000.00	90,097.22	
		ECL 3.95% 12/01/47	100,000.00	82,001.78	
		EDF 4.875% 09/21/38	200,000.00	165,671.27	
		EIX 2.25% 06/01/30	100,000.00	82,430.51	
		EIX 4.125% 03/01/48	100,000.00	79,213.27	
		EIX 5.95% 11/01/32	100,000.00	102,992.35	
		ELV 4.75% 02/15/33	100,000.00	95,584.21	
		ELV 4.9% 02/08/26	100,000.00	97,947.28	
		ELV 5.125% 02/15/53	100,000.00	94,361.38	
		EMR 2.2% 12/21/31	100,000.00	81,353.44	
		ENBCN 5.7% 03/08/33	100,000.00	99,565.94	
		ENELIM 1.875% 07/12/28	200,000.00	166,572.77	
		ENELIM 2.875% 07/12/41	200,000.00	129,006.85	
		EOG 4.375% 04/15/30	100,000.00	96,742.25	
		EPD 3.7% 02/15/26	100,000.00	96,140.62	
		EPD 7.55% 04/15/38	100,000.00	112,885.15	
		EQH 5% 04/20/48	100,000.00	84,743.48	
		EQIX 1% 09/15/25	100,000.00	90,376.22	
		EQNR 3.625% 04/06/40	100,000.00	81,791.83	
		EQR 1.85% 08/01/31	100,000.00	77,260.43	
		ES 5.45% 03/01/28	100,000.00	99,967.81	
		ET 5.55% 02/15/28	100,000.00	99,129.33	
		ET 5.75% 02/15/33	100,000.00	99,128.14	
		ETR 1.9% 06/15/28	100,000.00	84,590.04	
		EXC 5.15% 03/15/28	100,000.00	99,042.79	
		EXPE 4.625% 08/01/27	100,000.00	96,228.94	
		FCX 4.125% 03/01/28	100,000.00	93,796.00	
		FDX 3.25% 05/15/41	100,000.00	72,771.13	
		FDX 4.05% 02/15/48	100,000.00	78,041.79	
		FIS 3.1% 03/01/41	100,000.00	68,544.35	
		FISV 5.45% 03/02/28	100,000.00	99,882.57	
		FOXA 4.709% 01/25/29	100,000.00	96,331.62	
		GD 2.85% 06/01/41	100,000.00	73,993.83	
		GE 4.35% 05/01/50	100,000.00	84,541.66	
		GEHC 5.857% 03/15/30	100,000.00	101,392.87	
		GILD 2.8% 10/01/50	100,000.00	65,727.26	
		GIS 4.95% 03/29/33	100,000.00	97,488.63	
		GLENLN 1.625% 04/27/26	100,000.00	90,109.68	

		GM 5.25% 03/01/26	100,000.00	98,181.18	
		GM 5.4% 04/01/48	100,000.00	84,544.39	
		GM 5.4% 10/15/29	100,000.00	96,859.78	
		GM 5% 04/09/27	100,000.00	96,934.50	
		GMT 4% 06/30/30	100,000.00	90,013.52	
		GOOGL 2.05% 08/15/50	100,000.00	60,897.46	
		GPN 4.95% 08/15/27	100,000.00	96,758.80	
		GS 1.431% 03/09/27	200,000.00	178,043.28	
		GS 2.6% 02/07/30	100,000.00	83,806.30	
		GS 3.85% 01/26/27	100,000.00	94,488.51	
		GS 4.482% 08/23/28	100,000.00	95,649.00	
		GS 5.7% 11/01/24	100,000.00	99,861.76	
		GS 6.75% 10/01/37	100,000.00	105,225.31	
		HAL 2.92% 03/01/30	100,000.00	86,833.09	
		HAS 3.55% 11/19/26	100,000.00	93,030.26	
		HCA 4.375% 03/15/42	100,000.00	80,510.57	
		HCA 5.625% 09/01/28	100,000.00	99,267.89	
		HD 0.9% 03/15/28	100,000.00	83,638.22	
		HD 3.3% 04/15/40	100,000.00	79,119.82	
		HES 5.8% 04/01/47	100,000.00	95,158.14	
		HIG 4.4% 03/15/48	100,000.00	81,444.43	
		HNDA 1.8% 01/13/31	100,000.00	79,723.42	
		HNDA 4.75% 01/12/26	100,000.00	99,187.29	
		HON 2.5% 11/01/26	100,000.00	93,028.35	
		HPE 5.9% 10/01/24	100,000.00	99,945.28	
		HPQ 4% 04/15/29	100,000.00	92,610.05	
		HSBC 6.161% 03/09/29	200,000.00	199,884.44	
		HSBC 7.336% 11/03/26	200,000.00	205,887.07	
		HUM 5.7% 03/13/26	100,000.00	99,945.46	
		HYNMTR 1.5% 06/15/26	100,000.00	88,178.51	
		IBM 4.15% 07/27/27	100,000.00	96,397.34	
		IBM 4.75% 02/06/33	100,000.00	96,372.65	
		ICE 5.2% 06/15/62	100,000.00	96,637.00	
		IFF 3.268% 11/15/40	100,000.00	68,879.82	
		INTC 2.45% 11/15/29	100,000.00	85,788.99	
		INTC 4.875% 02/10/26	100,000.00	99,415.05	
		INTC 5.2% 02/10/33	100,000.00	99,060.78	
		IPG 3.375% 03/01/41	100,000.00	71,118.71	
		ISPIM 8.248% 11/21/33	200,000.00	206,646.14	
		JCI 4.5% 02/15/47	100,000.00	84,933.03	
		JNJ 0.55% 09/01/25	100,000.00	91,401.66	
		JPM 1.04% 02/04/27	200,000.00	177,404.89	

		JPM 1.47% 09/22/27	100,000.00	87,484.74	
		JPM 3.782% 02/01/28	100,000.00	94,250.24	
		JPM 3.897% 01/23/49	100,000.00	78,481.31	
		JPM 4.08% 04/26/26	100,000.00	97,229.27	
		JPM 4.565% 06/14/30	100,000.00	94,836.37	
		JPM 5.546% 12/15/25	100,000.00	99,588.62	
		K 5.25% 03/01/33	100,000.00	98,907.23	
		KDP 3.95% 04/15/29	100,000.00	93,390.64	
		KHC 6.5% 02/09/40	100,000.00	105,829.67	
		KMI 1.75% 11/15/26	100,000.00	88,219.86	
		KMI 5.2% 06/01/33	100,000.00	95,261.40	
		KO 3.375% 03/25/27	100,000.00	95,850.90	
		KO 3% 03/05/51	100,000.00	73,347.65	
		KOROIL 4.75% 04/03/26	200,000.00	196,462.91	
		KR 4.45% 02/01/47	100,000.00	84,879.74	
		LHX 1.8% 01/15/31	100,000.00	78,096.16	
		LIN 1.1% 08/10/30	100,000.00	78,497.03	
		LLY 3.375% 03/15/29	100,000.00	93,094.16	
		LMT 5.7% 11/15/54	100,000.00	107,926.06	
		LNC 4.35% 03/01/48	100,000.00	69,897.20	
		LOW 4.05% 05/03/47	100,000.00	78,410.89	
		LOW 5.15% 07/01/33	100,000.00	98,138.57	
		LUV 5.125% 06/15/27	100,000.00	98,790.22	
		LYB 3.375% 10/01/40	100,000.00	72,106.83	
		MA 2.95% 03/15/51	100,000.00	70,741.25	
		MAR 4.625% 06/15/30	100,000.00	94,379.69	
		MBGGR 5.375% 11/26/25	150,000.00	150,171.62	
		MCD 4.2% 04/01/50	100,000.00	83,784.11	
		MCD 4.6% 09/09/32	100,000.00	97,538.81	
		MDLZ 1.5% 02/04/31	100,000.00	77,326.06	
		MDT 4.375% 03/15/35	100,000.00	94,121.04	
		MET 2.8% 03/21/25	150,000.00	142,754.57	
		MET 5% 01/06/26	150,000.00	147,974.74	
		META 4.65% 08/15/62	100,000.00	84,546.90	
		MFCCN 3.703% 03/16/32	100,000.00	89,759.16	
		MITCO 1.125% 07/15/26	200,000.00	176,135.38	
		MIZUHO 2.564% 09/13/31	200,000.00	154,911.43	
		MIZUHO 5.414% 09/13/28	200,000.00	197,390.54	
		MKC 0.9% 02/15/26	100,000.00	88,976.29	
		MLM 4.25% 12/15/47	100,000.00	80,886.61	
		MMC 4.2% 03/01/48	100,000.00	82,348.43	
		MMM 2.65% 04/15/25	100,000.00	95,269.24	
		MO 3.4% 02/04/41	100,000.00	68,489.11	

		MO 5.95% 02/14/49	100,000.00	93,048.65	
		MPLX 2.65% 08/15/30	100,000.00	82,623.04	
		MQGAU 4.098% 06/21/28	100,000.00	93,141.79	
		MRK 3.4% 03/07/29	100,000.00	92,778.07	
		MS 1.164% 10/21/25	200,000.00	186,988.61	
		MS 3.217% 04/22/42	100,000.00	73,409.35	
		MS 4.457% 04/22/39	100,000.00	86,994.22	
		MS 4.5% 06/20/28	100,000.00	95,449.98	
		MS 6.138% 10/16/26	100,000.00	100,929.61	
		MS 6.296% 10/18/28	100,000.00	102,117.01	
		MSCI 3.25% 08/15/33	100,000.00	79,778.60	
		MSFT 2.921% 03/17/52	100,000.00	71,860.78	
		MSFT 3.3% 02/06/27	100,000.00	95,491.00	
		MSFT 4.1% 02/06/37	100,000.00	94,793.24	
		MTNA 6.55% 11/29/27	100,000.00	102,055.43	
		MU 4.185% 02/15/27	100,000.00	95,324.61	
		MUFG 4.7% 03/10/44	200,000.00	180,165.85	
		MUFG 5.133% 07/20/33	200,000.00	193,121.81	
		MYLIFE 5.1% 04/26/48	200,000.00	191,569.32	
		NAB 4.966% 01/12/26	250,000.00	247,654.92	
		NEE 1.875% 01/15/27	100,000.00	88,537.17	
		NEE 3.95% 03/01/48	100,000.00	81,931.91	
		NEE 5.05% 04/01/28	100,000.00	100,135.87	
		NEE 6.051% 03/01/25	100,000.00	100,493.19	
		NESNVX 4.95% 03/14/30	150,000.00	150,117.86	
		NFLX 5.875% 11/15/28	100,000.00	102,452.90	
		NI 0.95% 08/15/25	100,000.00	91,120.15	
		NIPLIF 2.75% 01/21/51	200,000.00	164,218.44	
		NKE 3.375% 03/27/50	100,000.00	78,439.22	
		NOC 5.15% 05/01/40	100,000.00	96,637.18	
		NOMURA 5.605% 07/06/29	200,000.00	195,119.72	
		NOVNVX 2% 02/14/27	100,000.00	91,080.97	
		NRUC 4.3% 03/15/49	100,000.00	82,284.94	
		NSC 4.15% 02/28/48	100,000.00	83,054.87	
		NTRCN 5.8% 03/27/53	100,000.00	98,087.84	
		NTT 2.065% 04/03/31	200,000.00	161,915.39	
		NVDA 3.5% 04/01/50	100,000.00	78,949.69	
		NWG 5.516% 09/30/28	200,000.00	194,550.77	
		NWIDE 4.85% 07/27/27	200,000.00	192,587.86	
		O 4.625% 11/01/25	100,000.00	98,504.66	
		OKE 6.1% 11/15/32	100,000.00	100,107.49	
		ORCL 2.5% 04/01/25	100,000.00	95,147.10	

		ORCL 3.65% 03/25/41	100,000.00	74,952.58	
		ORCL 4.5% 05/06/28	100,000.00	96,614.58	
		ORCL 4.9% 02/06/33	100,000.00	95,160.52	
		ORCL 6.9% 11/09/52	100,000.00	108,645.08	
		ORIX 2.25% 03/09/31	100,000.00	80,879.03	
		ORIX 5% 09/13/27	100,000.00	98,540.51	
		OTIS 3.112% 02/15/40	100,000.00	75,752.90	
		OXY 6.45% 09/15/36	100,000.00	101,538.50	
		PARA 4.75% 05/15/25	100,000.00	97,989.08	
		PCG 3.3% 08/01/40	100,000.00	66,461.54	
		PCG 4.55% 07/01/30	100,000.00	89,320.27	
		PCG 4.95% 07/01/50	100,000.00	76,411.88	
		PEG 4.05% 05/01/48	100,000.00	82,960.09	
		PEP 3.6% 02/18/28	100,000.00	95,723.74	
		PEP 4% 05/02/47	100,000.00	89,774.14	
		PERTIJ 2.3% 02/09/31	200,000.00	161,032.04	
		PETMK 4.55% 04/21/50	200,000.00	181,001.67	
		PFE 3.9% 03/15/39	100,000.00	87,289.82	
		PFG 3.7% 05/15/29	100,000.00	90,800.63	
		PG 3.55% 03/25/40	100,000.00	86,637.90	
		PH 4.5% 09/15/29	100,000.00	96,040.52	
		PLD 4.75% 06/15/33	100,000.00	95,717.80	
		PM 5.375% 02/15/33	100,000.00	98,206.97	
		PNC 4.758% 01/26/27	100,000.00	97,415.62	
		PRU 1.5% 03/10/26	100,000.00	91,145.77	
		PRU 6.75% 03/01/53	100,000.00	100,191.00	
		PSA 1.5% 11/09/26	100,000.00	89,201.35	
		PSX 4.95% 12/01/27	100,000.00	98,272.90	
		PXD 5.1% 03/29/26	100,000.00	99,121.20	
		PYPL 4.4% 06/01/32	100,000.00	94,726.42	
		QCOM 6% 05/20/53	100,000.00	108,439.33	
		R 3.35% 09/01/25	100,000.00	94,921.32	
		RABOBK 1.106% 02/24/27	250,000.00	220,190.42	
		RDSALN 2.75% 04/06/30	100,000.00	88,160.92	
		RDSALN 2.875% 11/26/41	100,000.00	72,531.91	
		RIOLN 5.125% 03/09/53	100,000.00	98,499.29	
		ROSW 2.076% 12/13/31	200,000.00	161,846.59	
		RPRX 1.2% 09/02/25	100,000.00	90,349.99	
		RPRX 2.2% 09/02/30	100,000.00	79,150.83	
		RSG 5% 04/01/34	100,000.00	98,006.20	
		RTX 4.35% 04/15/47	100,000.00	86,612.50	
		RY 4.875% 01/12/26	100,000.00	98,565.76	
		RY 6% 11/01/27	100,000.00	101,935.00	

		SANUK 6.534% 01/10/29	200,000.00	200,271.67	
		SBUX 4.8% 02/15/33	100,000.00	97,336.42	
		SCHW 2.45% 03/03/27	100,000.00	89,194.57	
		SHBASS 3.95% 06/10/27	250,000.00	235,559.65	
		SHW 3.45% 06/01/27	100,000.00	93,508.58	
		SJM 2.75% 09/15/41	100,000.00	68,152.10	
		SO 4.25% 07/01/36	100,000.00	86,942.43	
		SO 4.7% 05/15/32	100,000.00	94,953.48	
		SOCGEN 3.653% 07/08/35	200,000.00	158,773.63	
		SOCGEN 6.447% 01/12/27	200,000.00	199,583.00	
		SPG 2.45% 09/13/29	100,000.00	83,115.68	
		SPGI 4.75% 08/01/28	100,000.00	98,596.72	
		SPLLLC 5.9% 09/15/37	100,000.00	99,772.42	
		SRE 3.7% 04/01/29	100,000.00	91,246.99	
		SRE 4% 02/01/48	100,000.00	76,146.80	
		STLD 1.65% 10/15/27	100,000.00	84,583.52	
		STT 2.203% 02/07/28	100,000.00	89,512.12	
		STZ 2.25% 08/01/31	100,000.00	80,318.70	
		STZ 4.35% 05/09/27	100,000.00	96,889.33	
		SUCN 3.75% 03/04/51	100,000.00	71,451.80	
		SUMI 5.55% 03/09/28	200,000.00	201,102.90	
		SUMIBK 2.296% 01/12/41	200,000.00	129,372.67	
		SUMIBK 3.784% 03/09/26	200,000.00	190,582.20	
		SUMIFL 5.353% 04/25/28	200,000.00	197,593.56	
		SYK 1.15% 06/15/25	100,000.00	92,223.05	
		SYY 6.6% 04/01/50	100,000.00	111,338.74	
		T(AT&T) 05/15/35	100,000.00	89,962.32	
		T(AT&T) 09/15/53	100,000.00	68,312.88	
		T(AT&T) 1.7% 03/25/26	100,000.00	90,891.47	
		T(AT&T) 3.65% 09/15/59	100,000.00	67,081.35	
		T(AT&T) 3.8% 12/01/57	100,000.00	69,762.24	
		T(AT&T) 4.35% 03/01/29	100,000.00	95,134.74	
		TACHEM 5.25% 06/23/45	200,000.00	192,928.06	
		TAISEM 1.75% 10/25/26	200,000.00	178,930.07	
		TCKBCN 3.9% 07/15/30	100,000.00	89,694.03	
		TD 4.108% 06/08/27	100,000.00	94,920.34	
		TD 5.103% 01/09/26	100,000.00	99,312.51	
		TELEFO 5.52% 03/01/49	150,000.00	132,435.69	
		TENCNT 1.81% 01/26/26	200,000.00	182,267.51	
		TFC 4.873% 01/26/29	100,000.00	95,297.03	
		TGT 1.95% 01/15/27	100,000.00	91,028.10	
		TMUS 2.25% 02/15/26	100,000.00	91,927.63	

		TMUS 3.375% 04/15/29	100,000.00	89,294.19	
		TMUS 5.2% 01/15/33	100,000.00	97,585.18	
		TOYOTA 3.05% 03/22/27	100,000.00	93,036.25	
		TOYOTA 3.375% 04/01/30	100,000.00	90,727.54	
		TRPCN 1% 10/12/24	100,000.00	94,059.80	
		TSN 4.35% 03/01/29	100,000.00	94,329.06	
		TTEFP 2.986% 06/29/41	100,000.00	74,277.31	
		TTEFP 3.386% 06/29/60	100,000.00	70,935.26	
		TXN 3.875% 03/15/39	100,000.00	87,416.24	
		UBS 4.194% 04/01/31	250,000.00	219,283.85	
		UBS 9.016% 11/15/33	250,000.00	293,086.92	
		UHS 2.65% 10/15/30	100,000.00	80,942.46	
		UNH 4.5% 04/15/33	100,000.00	95,686.11	
		UNH 4.75% 05/15/52	100,000.00	92,234.54	
		UNH 5.15% 10/15/25	100,000.00	100,263.75	
		UNP 2.891% 04/06/36	100,000.00	77,969.69	
		UNP 3.799% 04/06/71	100,000.00	73,963.71	
		UNP 4.95% 05/15/53	100,000.00	96,969.60	
		UPS 3.9% 04/01/25	100,000.00	97,912.37	
		UPS 5.05% 03/03/53	100,000.00	99,092.33	
		V 1.1% 02/15/31	100,000.00	77,631.99	
		V 3.65% 09/15/47	100,000.00	82,288.79	
		VALEBZ 3.75% 07/08/30	100,000.00	87,052.85	
		VLO 3.65% 12/01/51	100,000.00	68,103.78	
		VMC 5.8% 03/01/26	100,000.00	99,836.96	
		VMW 4.65% 05/15/27	100,000.00	96,463.13	
		VOD 5.625% 02/10/53	100,000.00	95,598.51	
		VTR 3% 01/15/30	100,000.00	84,526.17	
		VTRS 3.85% 06/22/40	100,000.00	67,391.54	
		VZ 2.1% 03/22/28	100,000.00	87,093.66	
		VZ 3.15% 03/22/30	100,000.00	87,732.12	
		VZ 3.4% 03/22/41	100,000.00	74,859.22	
		VZ 3.5% 11/01/24	100,000.00	97,438.26	
		VZ 3.7% 03/22/61	100,000.00	70,057.42	
		WBA 3.2% 04/15/30	100,000.00	83,746.06	
		WBD 3.95% 03/20/28	100,000.00	92,557.33	
		WBD 4.65% 05/15/50	100,000.00	74,093.47	
		WEC 1.8% 10/15/30	100,000.00	78,404.73	
		WELL 2.7% 02/15/27	100,000.00	90,122.16	
		WFC 2.164% 02/11/26	100,000.00	94,241.17	
		WFC 2.572% 02/11/31	100,000.00	83,235.23	
		WFC 3.526% 03/24/28	100,000.00	92,818.28	
		WFC 4.54% 08/15/26	200,000.00	195,289.84	

	WFC 4.611% 04/25/53	100,000.00	84,531.37	
	WFC 4.808% 07/25/28	100,000.00	96,885.66	
	WHR 4.6% 05/15/50	100,000.00	81,001.60	
	WM 0.75% 11/15/25	100,000.00	90,149.11	
	WMB 3.95% 05/15/50	100,000.00	75,228.54	
	WMT 1.8% 09/22/31	100,000.00	81,531.93	
	WMT 2.65% 09/22/51	100,000.00	68,829.28	
	WPC 2.4% 02/01/31	100,000.00	79,054.23	
	WSTP 3.133% 11/18/41	100,000.00	65,943.11	
	WTRG 2.4% 05/01/31	100,000.00	79,933.48	
	XEL 3.6% 09/15/47	100,000.00	76,488.28	
	XOM 2.992% 03/19/25	100,000.00	96,359.59	
	XOM 3.482% 03/19/30	100,000.00	92,332.94	
	ZBH 3.05% 01/15/26	100,000.00	94,263.95	
	ZTS 5.4% 11/14/25	100,000.00	100,334.08	
アメリカドル 小計		52,650,000.00	47,055,188.69 (6,707,246,595)	
カナダドル	BCECN 3% 03/17/31	100,000.00	85,124.56	
	BMO 1.928% 07/22/31	100,000.00	88,368.43	
	BMO 2.37% 02/03/25	100,000.00	94,948.18	
	BNCN 4.82% 01/28/26	100,000.00	97,573.60	
	BNS 1.95% 01/10/25	100,000.00	94,539.29	
	CM 4.95% 06/29/27	100,000.00	98,010.24	
	CNRCN 3.2% 07/31/28	100,000.00	92,671.99	
	CNRCN 3.6% 02/08/49	100,000.00	81,330.31	
	CUCN 4.851% 06/03/52	100,000.00	96,684.45	
	CVECN 3.5% 02/07/28	100,000.00	92,707.85	
	ENBCN 5.7% 11/09/27	100,000.00	100,786.93	
	ENBCN 6.1% 11/09/32	100,000.00	103,526.49	
	FFHCN 3.95% 03/03/31	100,000.00	85,337.54	
	GWOCN 2.981% 07/08/50	100,000.00	70,533.21	
	HYDONE 4.17% 06/06/44	100,000.00	90,793.52	
	HYDONE 4.91% 01/27/28	100,000.00	99,773.48	
	LCN 2.284% 05/07/30	100,000.00	83,513.11	
	MFCCN 5.409% 03/10/33	100,000.00	98,075.60	
	MGCN 4.95% 01/31/31	100,000.00	98,248.09	
	NACN 5.296% 11/03/25	100,000.00	99,196.55	
	NGGLN 5.221% 09/16/31	100,000.00	97,975.21	
	PSPCAP 3% 11/05/25	150,000.00	143,871.80	
	RCICN 5.25% 04/15/52	100,000.00	90,928.87	
	RY 2.088% 06/30/30	100,000.00	92,627.14	
	RY 2.328% 01/28/27	100,000.00	89,931.25	

	SRUUCN 3.192% 06/11/27	100,000.00	89,860.98	
	T(AT&T) 4% 11/25/25	150,000.00	144,348.34	
	TCN 2.35% 01/27/28	100,000.00	87,930.90	
	TD 2.26% 01/07/27	100,000.00	89,819.00	
	TD 3.105% 04/22/30	100,000.00	94,866.96	
	TD 4.68% 01/08/29	100,000.00	96,814.96	
	TRPCN 3.3% 07/17/25	100,000.00	95,548.98	
	TRPCN 5.92% 05/12/52	100,000.00	102,188.39	
カナダドル 小計		3,400,000.00	3,168,456.20 (339,975,350)	
ユーロ	AALLN 4.5% 09/15/28	100,000.00	99,596.70	
	AAPL 0.5% 11/15/31	100,000.00	79,768.90	
	ABBV 1.25% 11/18/31	100,000.00	81,874.70	
	ABBV 2.125% 06/01/29	100,000.00	90,651.32	
	ABESM 1.25% 02/07/28	100,000.00	87,863.10	
	ABIBB 2.125% 12/02/27	100,000.00	93,969.90	
	ABIBB 2.875% 04/02/32	100,000.00	93,368.30	
	ABNANV 0.375% 01/14/35	100,000.00	71,088.50	
	ABNANV 3.625% 01/10/26	100,000.00	98,783.30	
	ABNANV 5.125% 02/22/33	100,000.00	97,519.10	
	ACACB 0.01% 04/12/28	100,000.00	84,453.00	
	ACACB 3.25% 09/28/32	100,000.00	97,820.11	
	ACAFP 1.5% 10/06/31	100,000.00	74,699.45	
	ACAFP 1.875% 04/22/27	100,000.00	92,929.30	
	ACAFP 1% 09/18/25	100,000.00	93,859.10	
	ACEIM 3.875% 01/24/31	100,000.00	96,655.83	
	ADNA 3.5% 04/04/28	100,000.00	98,536.21	
	ADPFP 2.125% 10/02/26	100,000.00	95,006.90	
	AIB 3.625% 07/04/26	100,000.00	97,741.60	
	AIFP 2.875% 09/16/32	100,000.00	93,522.40	
	AIRFP 1.625% 04/07/25	100,000.00	96,355.72	
	AKERBP 1.125% 05/12/29	100,000.00	82,490.80	
	ALDFP 4.75% 10/13/25	100,000.00	100,877.97	
	ALVGR 2.121% 07/08/50	100,000.00	81,464.19	
	ALVGR 4.252% 07/05/52	100,000.00	91,682.44	
	AMXLMM 0.75% 06/26/27	100,000.00	88,291.60	
	ANNGR 0.375% 06/16/27	100,000.00	83,277.50	
	ANNGR 0.625% 12/14/29	100,000.00	75,026.79	
	ANZ 3.437% 04/04/25	200,000.00	198,063.90	
	ARRFP 0% 06/19/28	100,000.00	83,236.30	
	ASSGEN 3.875% 01/29/29	100,000.00	96,057.40	
	ATIM 2.375% 11/25/33	100,000.00	76,787.90	
	ATOSTR 4.75% 01/24/31	100,000.00	98,309.20	

		AXASA 1.875% 07/10/42	100,000.00	74,673.67	
		BAC 0.694% 03/22/31	100,000.00	78,320.90	
		BAC 1.949% 10/27/26	100,000.00	94,142.00	
		BASGR 3.125% 06/29/28	100,000.00	97,346.15	
		BATSLN 3.125% 04/07/28	100,000.00	94,945.50	
		BAYNGR 0.75% 01/06/27	100,000.00	89,400.60	
		BAYNGR 1% 01/12/36	100,000.00	68,222.60	
		BBVASM 1% 01/16/30	100,000.00	92,915.80	
		BFCM 1% 05/23/25	100,000.00	94,319.50	
		BFCM 4% 11/21/29	100,000.00	98,887.35	
		BHP 3.25% 09/24/27	100,000.00	97,393.47	
		BKNG 0.1% 03/08/25	100,000.00	93,772.55	
		BKTSM 1.25% 12/23/32	100,000.00	81,941.50	
		BMO 0.05% 06/08/29	100,000.00	80,944.40	
		BMO 0.125% 01/26/27	200,000.00	175,409.60	
		BMO 1% 04/05/26	200,000.00	184,736.80	
		BMW 0.2% 01/11/33	100,000.00	72,885.40	
		BMW 0% 01/11/26	100,000.00	91,388.40	
		BNFP 1% PERP	100,000.00	87,214.90	
		BNP 2.125% 01/23/27	100,000.00	93,898.70	
		BNP 2.5% 03/31/32	100,000.00	88,918.30	
		BNS 0.01% 09/14/29	100,000.00	79,745.70	
		BNS 3.25% 01/18/28	200,000.00	195,654.40	
		BPCECB 1.75% 05/27/32	100,000.00	86,490.10	
		BPCECB 3.125% 07/20/27	200,000.00	195,840.40	
		BPCECB 3.25% 04/12/28	200,000.00	196,408.80	
		BPCECB 3% 10/17/29	100,000.00	96,832.60	
		BPCEGP 0.5% 09/15/27	100,000.00	87,670.80	
		BPCEGP 2.25% 03/02/32	100,000.00	88,368.50	
		BPCEGP 3.625% 04/17/26	100,000.00	98,316.60	
		BPLN 3.25 PERP	100,000.00	92,631.00	
		BRITEL 0.5% 09/12/25	100,000.00	92,628.17	
		BRK 1.625% 03/16/35	100,000.00	78,105.70	
		C 3.713% 09/22/28	100,000.00	97,194.70	
		CABKSM 0.375% 11/18/26	100,000.00	90,284.30	
		CABKSM 6.25% 02/23/33	100,000.00	100,266.63	
		CAFFIL 0.01% 02/22/28	100,000.00	84,766.30	
		CAFFIL 0.125% 06/30/31	100,000.00	76,630.20	
		CAFP 1.875% 10/30/26	100,000.00	93,254.00	
		CAPFP 1.625% 04/15/26	100,000.00	94,191.40	
		CCEP 1.75% 03/27/26	100,000.00	94,702.67	
		CFF 0.01% 10/25/27	100,000.00	85,677.50	

		CFF 0.01% 10/29/35	100,000.00	65,262.01	
		CFF 0.6% 10/25/41	100,000.00	61,044.90	
		CFF 3.375% 09/16/31	100,000.00	98,980.20	
		CKHH 2% 04/13/30	100,000.00	85,893.89	
		CM 0.01% 10/07/26	200,000.00	176,484.60	
		CMCICB 3.125% 06/22/27	100,000.00	98,072.80	
		CMZB 2.75% 12/08/25	200,000.00	195,400.56	
		CMZB 2.875% 04/28/26	100,000.00	97,999.10	
		CMZB 3.125% 04/20/29	100,000.00	98,268.20	
		CNPFP 1.25% 01/27/29	100,000.00	82,160.40	
		CRH 3% 01/11/30	100,000.00	96,829.50	
		DAIGR 0.75% 09/10/30	100,000.00	82,759.50	
		DAIGR 2% 08/22/26	100,000.00	95,385.90	
		DANBNK 4% 01/12/27	100,000.00	98,497.70	
		DB 0.75% 02/17/27	100,000.00	89,453.30	
		DBOERS 1.625% 10/08/25	100,000.00	95,720.28	
		DELL 4.5% 10/18/27	100,000.00	100,777.20	
		DEXGRP 0.01% 01/22/27	100,000.00	88,184.00	
		DGFP 0% 11/27/28	100,000.00	83,354.20	
		DNBNO 0.01% 01/21/31	100,000.00	77,005.85	
		EDPPL 1.625% 01/26/26	100,000.00	94,503.20	
		EFFP 0.375% 01/05/26	100,000.00	92,098.70	
		EJRAIL 1.85% 04/13/33	100,000.00	83,534.40	
		ENBW 2.125% 08/31/2081	100,000.00	71,626.00	
		ENELIM 1.25% 01/17/35	100,000.00	71,502.50	
		ENELIM 6.625% PERP	100,000.00	100,886.20	
		ENFP 2.25% 06/29/29	100,000.00	91,300.50	
		ENGIFP 3.625% 01/11/30	100,000.00	98,210.30	
		EOANGR 3.875% 01/12/35	100,000.00	97,411.10	
		EQNR 1.375% 05/22/32	100,000.00	81,939.90	
		EXOIM 0.875% 01/19/31	100,000.00	77,882.76	
		FREGR 1.875% 05/24/25	100,000.00	95,851.84	
		GFCFP 0.875% 01/25/33	100,000.00	74,129.20	
		GS 4% 09/21/29	100,000.00	97,835.20	
		GSK 1.75% 05/21/30	100,000.00	88,516.80	
		HOLNSW 0.5% 09/03/30	100,000.00	76,446.50	
		HSBC 0.309% 11/13/26	100,000.00	90,550.30	
		HSBC 4.787% 03/10/32	100,000.00	99,394.90	
		HSBC 6.364% 11/16/32	100,000.00	101,508.00	
		HVB 0.375% 01/17/33	100,000.00	75,709.95	
		HVB 3% 07/13/26	100,000.00	98,029.90	
		IBESM 3.375% 11/22/32	100,000.00	97,066.83	
		IGIM 0.25% 06/24/25	100,000.00	92,605.50	

		INTNED 0.125% 11/29/25	100,000.00	94,015.00	
		INTNED 2.125% 05/23/26	100,000.00	95,565.20	
		INTNED 2.75% 11/21/25	100,000.00	97,668.30	
		INTNED 3% 02/15/26	200,000.00	196,314.00	
		INTNED 3% 02/15/33	100,000.00	96,379.30	
		JAPTOB 2.375 04/07/81	100,000.00	92,255.00	
		JDEPNA 0% 01/16/26	100,000.00	90,102.00	
		JPM 0.389% 02/24/28	100,000.00	86,673.50	
		JPM 1.963% 03/23/30	100,000.00	87,729.50	
		KBCBB 4.375% 11/23/27	100,000.00	99,300.90	
		KERFP 3.25% 02/27/29	100,000.00	98,347.60	
		LBBW 0.375% 02/21/31	100,000.00	73,769.50	
		LBBW 0.375% 02/28/28	100,000.00	83,673.60	
		LEGGR 0.375% 01/17/26	100,000.00	89,670.80	
		LIFP 2% 05/12/29	100,000.00	87,831.20	
		LIN 1.625% 03/31/35	100,000.00	78,930.50	
		LLOYDS 3.125% 08/24/30	100,000.00	91,060.70	
		MCFP 0.375% 02/11/31	100,000.00	80,984.20	
		MET 4% 04/05/28	100,000.00	99,336.50	
		MRKGR 1.625% 09/09/2080	100,000.00	89,490.00	
		MRLSM 1.75% 05/26/25	100,000.00	95,080.12	
		MS 4.813% 10/25/28	100,000.00	100,847.60	
		MUFG 0.848% 07/19/29	200,000.00	168,135.00	
		NAB 0.01% 01/06/29	100,000.00	81,502.80	
		NACN 3.5% 04/25/28	200,000.00	197,538.40	
		NDAQ 0.875% 02/13/30	100,000.00	80,346.15	
		NDASS 1.125% 02/16/27	100,000.00	90,088.00	
		NDASS 1% 03/30/29	200,000.00	174,293.00	
		NDASS 3.625% 02/10/26	100,000.00	98,626.70	
		NESNVX 3.5% 12/13/27	100,000.00	100,026.50	
		NGGLN 2.949% 03/30/30	100,000.00	91,661.18	
		NNGRNV 0.875% 11/23/31	100,000.00	79,575.70	
		NTT 0.399% 12/13/28	100,000.00	84,136.00	
		NWG 0.125% 11/12/25	100,000.00	90,608.50	
		NWG 5.763% 02/28/34	100,000.00	98,309.59	
		NWIDE 2% 04/28/27	100,000.00	91,896.40	
		OMVAV 0% 07/03/25	100,000.00	92,556.56	
		ORAFP 1.25% 07/07/27	100,000.00	91,187.20	
		ORAFP 3.625% 11/16/31	100,000.00	99,277.33	
		ORIX 4.477% 06/01/28	100,000.00	101,150.40	
		ORSTED 3.75% 03/01/30	100,000.00	98,906.11	
		PG 0.625% 10/30/24	100,000.00	95,928.80	

		PLD 4.25% 01/31/43	100,000.00	89,936.00	
		PLNIJ 2.875% 10/25/25	100,000.00	96,114.80	
		PRXNA 2.031% 08/03/32	100,000.00	71,470.20	
		RABOBK 3.875% 11/30/32	100,000.00	94,560.17	
		RDSALN 1.5% 04/07/28	100,000.00	90,080.41	
		RDSALN 1.875% 04/07/32	100,000.00	85,019.50	
		REESM 4.625% PERP	100,000.00	98,580.70	
		RELLN 1.3% 05/12/25	100,000.00	94,971.30	
		RENAUL 4.125% 12/01/25	100,000.00	98,892.86	
		RIFP 1.375% 04/07/29	100,000.00	88,363.70	
		RY 0.01% 10/05/28	100,000.00	82,620.29	
		RY 0.625% 03/23/26	200,000.00	183,203.60	
		SANFP 1% 03/21/26	100,000.00	93,273.80	
		SANTAN 1.625% 10/22/30	100,000.00	79,139.00	
		SANTAN 3.75% 01/16/26	100,000.00	98,500.00	
		SAPGR 0.375% 05/18/29	100,000.00	84,114.50	
		SEB 3.25% 05/04/28	100,000.00	98,524.90	
		SEB 3.25% 11/24/25	100,000.00	97,794.60	
		SEB 4% 11/09/26	100,000.00	98,577.00	
		SGOFP 1.625% 08/10/25	100,000.00	95,428.30	
		SHBASS 0.01% 09/30/30	100,000.00	77,740.10	
		SHBASS 3.75% 11/01/27	100,000.00	98,715.30	
		SIEGR 0.375% 06/05/26	100,000.00	91,125.40	
		SIEGR 3.625% 02/24/43	100,000.00	95,632.00	
		SMINLN 2% 02/23/27	100,000.00	92,450.40	
		SOCGEN 1.125% 06/30/31	100,000.00	87,257.90	
		SOCGEN 5.25% 09/06/32	100,000.00	98,721.60	
		SOCSFH 0.01% 12/02/26	100,000.00	88,473.70	
		SOCSFH 1.75% 05/05/34	100,000.00	84,161.40	
		SOCSFH 3.125% 02/24/32	100,000.00	97,082.00	
		SRGIM 3.375% 12/05/26	100,000.00	97,861.40	
		SSELN 4% PERP	100,000.00	92,004.50	
		STANLN 1.2% 09/23/31	100,000.00	84,770.69	
		STLA 1.25% 06/20/33	100,000.00	74,319.20	
		STLA 2.75% 05/15/26	100,000.00	96,703.60	
		SUFP 3.375% 04/13/34	100,000.00	96,408.20	
		SWEDA 1.3% 02/17/27	100,000.00	89,101.30	
		SWEDA 3.125% 07/05/28	100,000.00	97,824.00	
		TD 1.707% 07/28/25	200,000.00	191,122.00	
		TD 3.715% 03/13/30	200,000.00	199,770.50	
		TD 3.879% 03/13/26	100,000.00	99,668.50	
		TELEFO 1.788% 03/12/29	100,000.00	90,401.70	
		TELNO 1.75% 05/31/34	100,000.00	80,453.00	

	TEMASE 3.25% 02/15/27	150,000.00	147,608.10	
	TENN 0.125% 12/09/27	100,000.00	88,588.10	
	TENN 0.875% 06/16/35	100,000.00	76,138.80	
	TMO 1.875% 10/01/49	100,000.00	62,891.90	
	TOTAL 1.491% 04/08/27	100,000.00	92,018.84	
	TOYOTA 4.05% 09/13/29	100,000.00	100,474.00	
	ULFP 0.625% 05/04/27	100,000.00	85,111.66	
	UNANA 0.75% 02/28/26	100,000.00	93,090.00	
	UOBSP 0.387% 03/17/25	300,000.00	282,164.40	
	VATFAL 0.125% 02/12/29	100,000.00	82,287.50	
	VIEFP 0% 06/09/26	100,000.00	89,489.10	
	VIVFP 1.125% 12/11/28	100,000.00	87,098.12	
	VOD 2.5% 05/24/39	100,000.00	78,190.10	
	VW 3.75% 09/28/27	100,000.00	97,512.43	
	VW 3.875% 03/29/26	100,000.00	98,576.30	
	VW 4.125% 11/15/25	100,000.00	99,310.50	
	VZ 0.375% 03/22/29	100,000.00	81,702.20	
	VZ 4.75% 10/31/34	100,000.00	103,759.40	
	XOM 0.524% 06/26/28	100,000.00	85,610.10	
ユーロ 小計		23,950,000.00	21,688,373.47 (3,389,892,773)	
イギリスポンド	AAPL 3.05% 07/31/29	100,000.00	87,705.50	
	ANNFND 2.308% 10/06/32	100,000.00	68,457.36	
	AVLN 4% 06/03/55	100,000.00	73,598.60	
	BACR 3.75% 11/22/30	100,000.00	89,570.30	
	BNP 3.375% 01/23/26	100,000.00	91,862.70	
	BPLN 4.25% PERP	100,000.00	88,150.60	
	BRK 2.625% 06/19/59	100,000.00	56,413.80	
	CDTFIN 2.125% 09/22/28	100,000.00	80,518.60	
	CMCSA 4% 11/26/29	100,000.00	90,105.70	
	CPGLN 4.375% 09/08/32	100,000.00	90,328.00	
	EDF 5.5% 01/25/35	100,000.00	87,752.50	
	HSBC 8.201% 11/16/34	100,000.00	100,973.53	
	HTHROW 4.625% 10/31/46	100,000.00	78,336.30	
	INFLN 3.125% 07/05/26	100,000.00	89,793.90	
	LLOYDS 6.5% 09/17/40	100,000.00	110,280.43	
	MET 1.625% 10/12/28	100,000.00	79,550.59	
	NGGLN 2.75% 02/06/35	100,000.00	71,379.42	
	NGGLN 5.272% 01/18/43	100,000.00	89,058.90	
	NWG 3.619% 03/29/29	100,000.00	85,565.00	
	NWIDE 6.178% 12/07/27	100,000.00	96,701.40	
	ORSTED 2.5% 02/18/21	100,000.00	66,556.10	

		PFE 6.5% 06/03/38	100,000.00	108,332.09	
		SANTAN 4.75% 08/30/28	100,000.00	92,235.00	
		SANUK 2.92% 05/08/26	100,000.00	91,969.50	
		STANLN 4.375% 01/18/38	100,000.00	86,394.90	
	イギリスポンド 小計		2,500,000.00	2,151,590.72 (393,353,815)	
	スウェーデンクローナ	LANSBK 0.5% 09/20/28	1,000,000.00	834,351.06	
		LANSBK 1.5% 09/16/26	1,000,000.00	924,022.16	
		LANSBK 1% 09/15/27	500,000.00	442,544.57	
		NDASS 0.5% 09/16/26	1,000,000.00	895,042.76	
		NDASS 1% 09/17/25	500,000.00	468,080.53	
		NDASS 1% 09/18/24	1,000,000.00	964,160.14	
		SEB 1% 12/18/24	2,000,000.00	1,914,613.24	
		SWEDA 1% 03/17/27	1,000,000.00	897,344.27	
		SWEDA 1% 03/18/26	1,000,000.00	922,323.41	
		SWEDA 1% 06/18/25	1,000,000.00	942,788.61	
		SWEDA 3% 03/15/28	1,100,000.00	1,048,406.39	
	スウェーデンクローナ 小計		11,100,000.00	10,253,677.14 (135,040,927)	
	オーストラリアドル	ABIBB 4.1% 09/06/27	100,000.00	95,350.32	
		ANZ 5.906% 08/12/32	100,000.00	97,541.37	
		CBAAU 5% 01/13/28	200,000.00	196,976.94	
		QANAU 2.95% 11/27/29	100,000.00	81,382.41	
		WSTP 2.4% 01/25/27	100,000.00	90,547.09	
	オーストラリアドル 小計		600,000.00	561,798.13 (53,516,889)	
社債券合計				11,019,026,349 (11,019,026,349)	
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES MBS ETF	461,590	42,286,259.90	
	アメリカドル 小計		461,590	42,286,259.90 (6,027,483,486)	
投資信託受益証券合計			461,590	6,027,483,486 (6,027,483,486)	
合計				44,852,212,475 (44,852,212,475)	

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	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券　131銘柄	38.0%	—	19.3%
	地方債証券　12銘柄	1.2%	—	0.6%
	特殊債券　54銘柄	4.8%	—	2.4%
	社債券　461銘柄	29.5%	—	15.0%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	26.5%	13.4%
カナダドル	国債証券　22銘柄	30.7%	—	0.9%
	地方債証券　37銘柄	33.2%	—	1.0%
	特殊債券　14銘柄	11.4%	—	0.3%
	社債券　33銘柄	24.7%	—	0.8%
メキシコペソ	国債証券　13銘柄	100.0%	—	0.4%
ユーロ	国債証券　321銘柄	53.4%	—	13.3%
	地方債証券　28銘柄	3.4%	—	0.9%
	特殊債券　98銘柄	12.8%	—	3.2%
	社債券　222銘柄	30.3%	—	7.6%
イギリスポンド	国債証券　55銘柄	74.1%	—	3.2%
	特殊債券　7銘柄	6.0%	—	0.3%
	社債券　25銘柄	20.0%	—	0.9%
スイスフラン	国債証券　14銘柄	100.0%	—	0.6%
スウェーデンクローナ	国債証券　8銘柄	27.4%	—	0.1%
	社債券　11銘柄	72.6%	—	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　9銘柄	100.0%	—	0.1%
デンマーククローネ	国債証券　7銘柄	100.0%	—	0.2%
チェココルナ	国債証券　14銘柄	100.0%	—	0.2%
ハンガリーフォリント	国債証券　11銘柄	100.0%	—	0.1%
ポーランドズロチ	国債証券　12銘柄	100.0%	—	0.2%
オーストラリアドル	国債証券　20銘柄	56.4%	—	0.9%
	地方債証券　21銘柄	27.4%	—	0.4%
	特殊債券　7銘柄	8.7%	—	0.1%
	社債券　5銘柄	7.5%	—	0.1%
ニュージーランドドル	国債証券　10銘柄	100.0%	—	0.2%
シンガポールドル	国債証券　14銘柄	100.0%	—	0.2%
マレーシアリンギット	国債証券　21銘柄	100.0%	—	0.4%
タイバーツ	国債証券　16銘柄	100.0%	—	0.4%
インドネシアルピア	国債証券　9銘柄	100.0%	—	0.5%
韓国ウォン	国債証券　15銘柄	100.0%	—	1.3%
イスラエルシェケル	国債証券　12銘柄	100.0%	—	0.1%
オフショア人民元	国債証券　37銘柄	48.5%	—	4.8%
	特殊債券　50銘柄	51.5%	—	5.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,863,231,597
コール・ローン	79,833,828
株式	146,874,045,514
投資信託受益証券	461,615,033
投資証券	123,704,439
派生商品評価勘定	60,761,090
未収入金	3,767,488,206
未収配当金	1,048,486,970
前払金	110,928,905
差入委託証拠金	1,158,899,011
流動資産合計	160,548,994,593
資産合計	160,548,994,593
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	115,827,927
未払金	245,954
未払解約金	5,115,734,934
未払利息	66
流動負債合計	5,231,808,881
負債合計	5,231,808,881
純資産の部	
元本等	
元本	41,095,182,350
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	114,222,003,362
元本等合計	155,317,185,712
純資産合計	155,317,185,712
負債純資産合計	160,548,994,593

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10日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2 .デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3 .外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4 .収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

	2023年 7月10日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	41,095,182,350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 3.7794円 (1万口当たり純資産額) (37,794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 7月10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 7月10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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	31,174,998,147円
期中追加設定元本額	12,637,800,831円
期中一部解約元本額	2,717,616,628円

区分	2023年 7月10日現在
期末元本額	41,095,182,350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	7,761,120,980円
世界経済インデックスファンド	9,123,466,028円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	5,941,865,854円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	7,100,760,108円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	108,509,879円
コア投資戦略ファンド（安定型）	48,466,827円
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）	1,090,054,799円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	766,684,850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）	395,161,858円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,313,518円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	97,044,363円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	49,003,308円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	2,785,120,889円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	229,100,538円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	924,633,937円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	157,523,287円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,220,230円
グローバル経済コア	405,802,572円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	164,387,778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	93,179,112円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	85,265,979円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	34,340,004円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	35,366,545円
１０資産分散投資ファンド	13,160,558円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,364,213,517円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	101,301,341円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	78,316,770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）	10,647,255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）	41,313,883円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,509,060,277
投資信託受益証券	46,345,401
投資証券	700,177
合計	7,556,105,855

(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 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	7,933,499,160	－	7,822,570,255	△110,928,905
合計		7,933,499,160	－	7,822,570,255	△110,928,905

(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10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	236,395,970	－	235,254,706	△1,141,264
	アメリカドル	236,395,970	－	235,254,706	△1,141,264
	売建	5,242,097,970	－	5,185,094,638	57,003,332
	アメリカドル	3,601,500,000	－	3,562,952,500	38,547,500
	ブラジルレアル	5,676,459	－	5,666,559	9,900
	香港ドル	1,546,692,000	－	1,529,421,600	17,270,400
	フィリピンペソ	88,229,511	－	87,053,979	1,175,532
合計		5,478,493,940	－	5,420,349,344	55,862,068

(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	1.35	189,444.60	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	7.48	126,636.40	
	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	15,749	70.67	1,112,981.83	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	63,831	24.89	1,588,753.59	
	NIO INC - ADR	201,974	9.99	2,017,720.26	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	30,159	39.16	1,181,026.44	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	6.18	489,876.24	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	55.59	3,694,066.68	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	29.55	362,962.65	
	IQIYI INC-ADR	59,454	5.16	306,782.64	
	JOYY INC	6,185	32.02	198,043.70	
	KANZHUN LTD	38,815	14.80	574,462.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	7.25	823,215.75	
	VK CO LTD	19,368	0.00	—	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	13.34	70,021.66	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	—	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	10,726	16.97	182,020.22	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	—	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	80,974	70.00	5,668,180.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	16.13	881,923.88	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	—	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	8,037	68.89	553,668.93	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	403,900	1.13	456,407.00	
	CREDICORP LTD	10,882	151.71	1,650,908.22	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	—	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	1.48	168,916.84	

	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	18.22	378,119.66	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	140,760	2.62	370,058.04	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	39.23	307,367.05	
	KE HOLDINGS INC	92,870	14.31	1,328,969.70	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.61	94,355.40	
アメリカドル 小計		2,059,883		24,776,889.38 (3,531,697,812)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,214,261	11.54	25,552,571.94	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	83.26	40,705,147.92	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	232.92	8,152,200.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	37.78	6,745,694.56	
	ALFA S.A.B.-A	313,500	10.30	3,229,050.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	123.34	12,580,680.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	488.16	16,389,972.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	319.58	19,168,408.40	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	170.72	7,287,183.20	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	590,690	16.97	10,024,009.30	
	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	68.79	56,908,591.20	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	175.67	14,382,981.25	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	190.37	59,612,461.80	
	GRUMA S.A.B.-B	25,960	279.04	7,243,878.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	88.62	16,111,116.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	38.56	7,010,208.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	51.95	7,413,265.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	412,300	147.48	60,806,004.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	271,700	41.10	11,166,870.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	4,969,540	18.56	92,234,662.40	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	16.18	3,577,398.00	
メキシコペソ 小計		11,688,330		486,302,353.37 (4,044,771,193)	
ブラジルレアル	COSAN SA	162,100	18.96	3,073,416.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	594,100	33.13	19,682,533.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	728,040	29.50	21,477,180.00	
	PRIO SA	130,000	39.35	5,115,500.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	19.30	1,459,080.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	12.72	1,264,368.00	
	GERDAU SA-PREF	155,590	26.14	4,067,122.60	
	SUZANO SA	121,779	44.51	5,420,383.29	
	VALE SA	525,387	65.46	34,391,833.02	
	WEG SA	255,844	37.00	9,466,228.00	
	CCR SA	248,600	13.78	3,425,708.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	93,140	70.14	6,532,839.60	

	RUMO SA	244,300	22.72	5,550,496.00	
	LOJAS RENNER S.A.	216,447	20.42	4,419,847.74	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	3.18	971,490.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	18.31	3,167,630.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	11.63	1,542,138.00	
	RAIA DROGASIL SA	189,280	28.49	5,392,587.20	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	151,800	14.00	2,125,200.00	
	AMBEV SA	756,200	14.85	11,229,570.00	
	JBS SA	110,000	17.75	1,952,500.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	16.73	1,678,152.84	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	4.37	4,567,322.98	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	31.64	3,027,948.00	
	HYPERA SA	54,500	45.74	2,492,830.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	14.50	4,727,333.50	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	16.28	13,482,802.96	
	BANCO DO BRASIL S.A.	156,500	49.96	7,818,740.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	780,281	29.14	22,737,388.34	
	ITAUSA SA	774,657	9.74	7,545,159.18	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	887,409	14.36	12,743,193.24	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	31.32	3,410,748.00	
	TOTVS SA	57,900	30.50	1,765,950.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	42.11	3,764,634.00	
	TIM SA	96,100	14.19	1,363,659.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	43.85	1,622,450.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	39.52	8,366,384.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	12.60	2,669,020.20	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	56.00	2,828,000.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	35.70	971,040.00	
	ENEVA SA	102,200	12.49	1,276,478.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	44.70	2,067,375.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	32.97	5,443,347.00	
ブラジルレアル 小計		11,721,498		268,097,606.69 (7,841,157,941)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	5,995.00	542,085,885.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,580.20	214,851,893.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	63,621.00	1,352,009,871.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	55.55	136,718,993.40	
	FALABELLA SA	70,837	1,985.50	140,646,863.50	
	CENCOSUD SA	306,432	1,630.00	499,484,160.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	6,670.00	49,257,950.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	84.20	638,505,692.60	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,193	25,451.00	157,618,043.00	

	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	37.99	438,790,920.31	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	108.49	378,772,764.35	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	52.55	134,595,158.90	
チリペソ 小計		28,285,639		4,683,338,195.06 (825,546,073)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	27,002	30,400.00	820,860,800.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	27,730.00	1,707,197,450.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	16,980.00	857,676,780.00	
コロンビアペソ 小計		139,078		3,385,735,030.00 (115,832,766)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	22.28	115,878.28	
	MYTILINEOS S.A.	20,295	30.96	628,333.20	
	OPAP SA	20,586	15.59	320,935.74	
	JUMBO SA	19,341	25.78	498,610.98	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.51	398,402.34	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.54	662,233.05	
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	5.95	438,158.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	14.74	386,291.18	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	10.28	574,569.76	
	TERNA ENERGY SA	13,651	19.19	261,962.69	
ユーロ 小計		926,142		4,285,375.22 (669,804,146)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	90.80	12,947,172.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	39.00	10,095,852.00	
	HEKTAS TICARET T.A.S	133,067	31.84	4,236,853.28	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	16,783	27.04	453,812.32	
	SASA POLYESTER SANAYI	118,024	58.10	6,857,194.40	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	59.05	5,879,372.30	
	KOC HOLDING AS	89,884	109.30	9,824,321.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	46.56	13,909,706.88	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,181	682.60	4,901,750.60	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	215.20	18,639,548.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	841.00	13,767,170.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	259.00	8,185,177.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	181.20	14,718,513.60	
	AKBANK T.A.S.	586,183	20.26	11,876,067.58	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	46.70	9,871,072.40	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	13.91	5,347,880.33	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	12.96	4,809,805.92	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	39.96	5,717,916.36	
トルコリラ 小計		3,076,763		162,039,186.17 (886,759,446)	

チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	665.50	8,853,146.50	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	79.90	4,850,729.00	
	CEZ AS	25,283	905.00	22,881,115.00	
チェココルナ 小計		99,296		36,584,990.50 (239,686,565)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	3,004.00	133,747,092.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	8,300.00	238,550,300.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	11,800.00	472,247,800.00	
ハンガリーフォリント 小計		113,285		844,545,192.00 (343,339,713)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	102,979	64.80	6,673,039.20	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	112.15	2,263,859.90	
	LPP SA	124	13,430.00	1,665,320.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	145.00	972,080.00	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	16.06	579,914.37	
	ALLEGRO.EU SA	83,795	32.00	2,681,440.00	
	PEPCO GROUP NV	22,887	35.84	820,270.08	
	DINO POLSKA SA	9,471	456.20	4,320,670.20	
	BANK PEKAO SA	27,684	106.10	2,937,272.40	
	M BANK SA	1,423	418.20	595,098.60	
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	36.65	4,775,385.05	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	381.00	2,797,683.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	38.51	3,332,231.79	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	7.12	710,775.60	
ポーランドズロチ 小計		635,320		35,125,040.19 (1,232,590,347)	
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 (118)	

香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	5.77	1,898,330.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	8.59	2,078,780.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	4.48	17,334,912.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	455,500	23.50	10,704,250.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	22,000	8.57	188,540.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	3,218,000	5.39	17,345,020.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	429,000	11.96	5,130,840.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.51	1,193,400.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	20.10	4,773,750.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	6.43	3,571,865.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	4.59	3,341,520.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	3.03	872,640.00	
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.20	3,402,000.00	
	DONGYUE GROUP	147,000	6.04	887,880.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	50.50	2,729,020.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	11.84	2,770,560.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	4.90	1,783,600.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	95,000	14.38	1,366,100.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	10.08	1,824,480.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	11.46	10,371,300.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.78	1,039,500.00	
	BOC AVIATION LTD	23,800	63.30	1,506,540.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.52	689,920.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	9.42	2,289,060.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	4.89	625,920.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	5.09	3,593,540.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	8.84	3,907,280.00	
	CITIC LTD	1,038,000	8.50	8,823,000.00	
	CRRC CORP LTD-H	936,000	4.16	3,893,760.00	
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	5.37	1,546,560.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	17.46	1,361,880.00	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	10.12	1,619,200.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	408,800	11.48	4,693,024.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	30.10	1,875,230.00	
	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	3.03	1,166,774.22	
	AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.95	1,273,300.00	
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	5.07	1,257,360.00	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	10.54	1,744,865.38	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	598,000	4.61	2,756,780.00	
	COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	7.81	4,045,970.50	
	COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	4.51	1,130,990.74	
	JD LOGISTICS INC	326,200	11.82	3,855,684.00	

JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	6.82	2,196,040.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	113.60	1,988,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	6.90	982,470.30	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.88	1,822,800.00	
BYD CO LTD-H	158,000	254.60	40,226,800.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	3.62	962,920.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	31.05	1,813,320.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	9.64	9,138,720.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	9.19	4,537,562.50	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	4.76	1,705,717.44	
LI AUTO INC-CLASS A	171,642	137.20	23,549,282.40	
MINTH GROUP LTD	176,000	21.45	3,775,200.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	54.60	9,127,045.20	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	17.06	3,992,040.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	198,800	77.30	15,367,240.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.28	1,436,640.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	310,600	23.30	7,236,980.00	
LI NING CO LTD	380,000	39.00	14,820,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	122,100	75.10	9,169,710.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	7.28	1,201,200.00	
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	28.20	1,240,800.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	16.78	3,926,520.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	235,000	12.24	2,876,400.00	
MEITUAN-CLASS B	787,350	119.10	93,773,385.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	30.80	7,530,600.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	16.30	2,718,840.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	13.30	1,050,700.00	
TRIP.COM GROUP LTD	87,657	262.40	23,001,196.80	
BAIDU INC-CLASS A	351,450	137.40	48,289,230.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	115.20	3,064,320.00	
CHINA LITERATURE LTD	51,600	32.15	1,658,940.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.99	2,523,320.00	
KINGSOFT CORP LTD	171,200	30.50	5,221,600.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	372,400	52.50	19,551,000.00	
NETEASE INC	313,630	147.60	46,291,788.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	968,500	326.60	316,312,100.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,575,888	84.30	217,147,358.40	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	10.26	1,067,040.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	103.70	933,300.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	13.60	3,427,200.00	
JD.COM INC - CL A	360,461	134.70	48,554,096.70	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	17.38	1,122,748.00	

TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	6.38	2,615,800.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	29.35	2,700,200.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	4.67	3,661,280.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	49.45	9,566,102.50	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	18.32	983,784.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	134.40	2,042,880.00	
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.46	2,515,440.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	458,000	28.00	12,824,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	47.70	11,734,200.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.48	856,080.00	
HUISHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
NONGFU SPRING CO LTD-H	282,600	42.10	11,897,460.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	7.52	1,466,400.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	11.52	4,792,320.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	68.20	7,911,200.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.34	507,200.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	556,000	5.19	2,885,640.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	16.08	771,840.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	30.55	2,673,125.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	18.78	469,500.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	43.65	3,291,210.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	13.40	884,400.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	10.42	4,159,664.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	14.88	1,910,592.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	23.85	4,560,120.00	
3SBIO INC	445,500	7.29	3,247,695.00	
AKESO INC	61,000	35.95	2,192,950.00	
BEIGENE LTD	110,905	115.70	12,831,708.50	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	11.86	2,929,420.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	6.50	9,023,040.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	6.23	2,111,970.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.37	1,637,820.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	16.50	2,178,000.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	43.15	220,065.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	12.56	1,532,320.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	30.25	6,140,750.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	23.40	782,730.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	20.30	1,481,900.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	3.42	6,740,820.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	63,688	62.05	3,951,840.40	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	567,000	37.80	21,432,600.00	
ZAI LAB LTD	128,250	22.80	2,924,100.00	

AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,935,000	2.85	11,214,750.00	
BANK OF CHINA LTD-H	12,394,200	2.76	34,207,992.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	4.45	6,103,063.75	
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	3.56	5,572,112.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	14,601,620	4.37	63,809,079.40	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.18	817,500.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	621,923	32.55	20,243,593.65	
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.86	1,928,784.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	8,728,515	3.61	31,509,939.15	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,075,000	4.33	4,654,750.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.78	648,960.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.12	1,989,960.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	13.62	4,783,344.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	13.68	3,909,402.00	
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.92	1,420,800.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	10.56	935,616.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	4.79	1,710,988.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	9.59	2,550,940.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,109,000	12.10	13,418,900.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	20.00	7,732,000.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	7.93	1,459,310.32	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	105,400	19.58	2,063,732.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.80	5,258,400.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	8.46	10,129,056.48	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,004,000	48.90	49,095,600.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	21.85	2,536,785.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	4.96	1,368,960.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	9.96	1,261,932.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	10.50	5,176,500.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	18.30	1,308,450.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	24.60	3,948,300.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	21.45	1,437,150.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.61	525,090.00	
LENOVO GROUP LTD	1,188,000	8.39	9,967,320.00	
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	74.20	8,866,900.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	2,404,200	10.80	25,965,360.00	
ZTE CORP-H	82,908	30.30	2,512,112.40	
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.87	6,161,340.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	27.90	1,660,050.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.84	1,122,400.00	
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	1.89	2,698,920.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	8.38	3,908,432.00	

	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	7.78	3,516,560.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.93	1,951,380.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,800	24.75	2,643,300.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	17.40	4,478,760.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	84.80	9,921,600.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	6.62	2,952,520.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.77	3,358,080.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	5.93	3,249,640.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	24.10	1,542,400.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.64	5,164,360.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	25.95	2,335,500.00	
	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	43,000	19.56	841,080.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	8.23	7,373,973.01	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	18.24	1,668,120.96	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	625,900	1.12	701,008.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	16.60	9,703,364.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	7.97	1,793,250.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	31.70	17,153,218.70	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	37.50	4,462,500.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	10.10	3,186,550.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,852,654	1.50	2,778,981.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	9.47	3,229,270.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	7.48	542,300.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	3.61	649,800.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	17.12	5,880,720.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	8.55	2,741,130.00	
香港ドル 小計		130,804,683		1,805,636,852.80 (32,880,647,089)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.11	872,839.48	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	21.86	1,932,424.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.02	2,506,728.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	4.79	3,628,904.00	
	GAMUDA BHD	159,500	4.38	698,610.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.05	689,509.30	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	6.84	733,802.04	
	MISC BHD	217,540	6.99	1,520,604.60	
	GENTING BHD	271,600	4.09	1,110,844.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.46	909,462.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.52	461,244.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.75	1,013,775.00	

	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	114,246	22.54	2,575,104.84	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	130.60	940,320.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	15.88	1,166,862.40	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.32	663,936.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.28	1,057,356.88	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.79	1,327,647.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	0.85	429,165.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.60	1,082,520.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	920,002	5.16	4,747,210.32	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	18.86	2,287,567.12	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	17.22	286,420.26	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	8.67	7,642,648.35	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,122,900	3.85	8,173,165.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.40	1,184,473.80	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.57	1,390,598.73	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	4.05	2,016,900.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.95	1,058,205.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	4.79	1,300,734.08	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	16.88	2,504,992.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	9.05	3,998,063.75	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.70	741,690.00	
マレーシアリンギット 小計		12,038,592		62,654,326.95 (1,916,884,071)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,713,200	8.95	15,333,140.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	150.50	30,220,400.00	
	PTT PCL-NVDR	1,377,500	33.75	46,490,625.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	44.25	12,992,021.25	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	33.25	6,862,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	38.50	18,716,159.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	35.00	7,094,500.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	322.00	41,988,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	71.25	46,661,625.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.30	6,781,100.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	7.50	6,071,250.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.60	3,727,380.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.00	11,970,354.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	38.75	7,060,250.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	13.80	11,593,863.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	20.70	16,402,680.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	34.50	6,127,200.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	62.75	60,014,100.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	33.25	7,910,507.50	

	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	64.25	2,974,775.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	19.40	10,794,160.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	27.75	8,133,525.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	26.75	50,506,675.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	220.00	18,194,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	83,200	129.50	10,774,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	19.20	8,422,080.00	
	SCB X PCL-NVDR	81,200	108.50	8,810,200.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	46.00	4,669,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	37.00	3,322,600.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	46.50	3,547,950.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	98.75	48,980,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	214.00	43,613,200.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	72.75	8,864,587.50	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	6.45	13,000,736.10	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	321,000	34.00	10,914,000.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	71,200	128.00	9,113,600.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	54.00	11,874,600.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	52.00	3,546,400.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	45.50	18,331,950.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	356,050	35.25	12,550,762.50	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	65.50	24,785,200.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.40	7,324,800.00	
タイバーツ 小計		20,515,990		707,067,955.85 (2,870,695,900)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	54.00	12,848,760.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	605.00	32,918,050.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	44.95	26,346,228.85	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	910.50	33,037,492.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	198.40	30,380,992.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	240.20	14,654,602.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	137.50	13,139,500.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	105.90	24,865,531.80	
	BDO UNIBANK INC	394,773	135.90	53,649,650.70	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	54.70	8,822,398.90	
	PLDT INC	10,460	1,300.00	13,598,000.00	
	ACEN CORP	821,840	5.20	4,273,568.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	328.00	17,443,040.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	24.00	30,741,600.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	31.90	49,551,865.00	
フィリピンペソ 小計		5,735,050		366,271,279.75 (938,496,900)	

インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,380.00	5,146,274,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,750.00	4,771,375,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,975.00	1,946,955,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	760.00	2,198,078,840.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,850.00	2,161,170,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	3,330.00	5,405,579,010.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	6,325.00	1,924,065,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	6,425.00	2,537,258,200.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	6,825.00	22,367,572,500.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	108.00	14,541,109,632.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,680.00	5,731,716,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	953,300	5,375.00	5,123,987,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	11,275.00	6,758,235,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,275.00	3,121,702,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	4,240.00	4,907,376,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,990.00	8,335,115,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	8,689,300	9,025.00	78,420,932,500.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	5,150.00	31,424,228,800.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	1,292,300	9,075.00	11,727,622,500.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	10,960,402	5,375.00	58,912,160,750.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,100.00	3,124,660,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	7,299,800	3,960.00	28,907,208,000.00	
インドネシアルピア 小計		193,375,608		309,494,381,732.00 (2,940,196,626)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	57,800.00	299,404,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	63,400.00	404,935,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	9,224	166,000.00	1,531,184,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	41,000.00	749,316,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	32,950.00	368,677,550.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	444,500.00	535,178,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	121,700.00	230,986,600.00	
	LG CHEM LTD	8,087	656,000.00	5,305,072,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	367,000.00	321,859,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	151,200.00	350,179,200.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	398,500.00	1,896,063,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	11,785	400,000.00	4,714,000,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	92,600.00	216,498,800.00	
	SKC CO LTD	1,432	104,300.00	149,357,600.00	
	CJ CORP	1,230	60,600.00	74,538,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	59,600.00	256,756,800.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	17,400.00	1,426,852,200.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	280,000.00	2,304,960,000.00	

GS HOLDINGS CORP	6,593	35,100.00	231,414,300.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	131,500.00	766,119,000.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	136,000.00	287,640,000.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	120,400.00	754,787,600.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	34,650.00	338,461,200.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,883	87,000.00	250,821,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	54,000.00	724,464,000.00	
LG CORP	16,658	82,800.00	1,379,282,400.00	
LG ENERGY SOLUTION	5,668	562,000.00	3,185,416,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	13,780	45,050.00	620,789,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	11,910	100,100.00	1,192,191,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	28,700.00	531,409,200.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	7,100.00	675,699,900.00	
SK INC	6,394	140,200.00	896,438,800.00	
SK SQUARE CO LTD	11,660	44,250.00	515,955,000.00	
HMM CO LTD	35,545	18,500.00	657,582,500.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	195,600.00	546,310,800.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	25,050.00	671,891,100.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,855.00	144,368,280.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	36,650.00	258,968,900.00	
HANON SYSTEMS	19,000	9,020.00	171,380,000.00	
HYUNDAI MOBIS	10,148	232,500.00	2,359,410,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	20,743	204,000.00	4,231,572,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	109,800.00	663,411,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	108,100.00	372,836,900.00	
KIA CORP	39,244	87,900.00	3,449,547,600.00	
COWAY CO LTD	9,036	42,700.00	385,837,200.00	
F&F CO LTD / NEW	3,017	112,400.00	339,110,800.00	
LG ELECTRONICS INC	17,254	123,000.00	2,122,242,000.00	
KANGWON LAND INC	28,528	16,520.00	471,282,560.00	
HYBE CO LTD	2,474	286,000.00	707,564,000.00	
KAKAO CORP	52,020	49,850.00	2,593,197,000.00	
KAKAO GAMES CORP	3,021	29,400.00	88,817,400.00	
KRAFTON INC	3,793	174,500.00	661,878,500.00	
NAVER CORP	21,578	195,000.00	4,207,710,000.00	
NCSOFT CORPORATION	2,709	279,500.00	757,165,500.00	
NETMARBLE CORP	2,465	44,900.00	110,678,500.00	
PEARL ABYSS CORP	4,605	50,100.00	230,710,500.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	73,500.00	320,680,500.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	166,800.00	272,217,600.00	
EMART	3,594	75,200.00	270,268,800.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	264,000.00	485,496,000.00	

	KT&G CORP	13,993	81,300.00	1,137,630,900.00	
	ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	122,400.00	384,580,800.00	
	AMOREPACIFIC CORP	3,762	94,700.00	356,261,400.00	
	LG H&H CO LTD	1,321	432,000.00	570,672,000.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	15,360	61,500.00	944,640,000.00	
	HLB INC	22,765	30,750.00	700,023,750.00	
	CELLTRION INC	17,544	148,600.00	2,607,038,400.00	
	CELLTRION PHARM INC	2,066	69,900.00	144,413,400.00	
	HANMI PHARM CO LTD	1,179	279,500.00	329,530,500.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,675	719,000.00	1,923,325,000.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	75,400.00	241,053,800.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	73,500.00	154,350,000.00	
	YUHAN CORPORATION	13,195	56,700.00	748,156,500.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	51,249	37,700.00	1,932,087,300.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,100.00	286,133,000.00	
	KAKAOBANK CORP	35,459	22,850.00	810,238,150.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	46,500.00	3,003,853,500.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	32,500.00	2,202,785,000.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	77,054	11,360.00	875,333,440.00	
	KAKAOPAY CORP	3,065	45,800.00	140,377,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	48,250.00	222,046,500.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	41,150.00	698,521,250.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,950.00	215,554,250.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,320.00	112,837,240.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	34,800.00	554,955,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	10,074	72,200.00	727,342,800.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	4,139	222,000.00	918,858,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	66,400.00	805,498,400.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	115,200.00	839,116,800.00	
	COSMOAM&T CO LTD	3,780	200,000.00	756,000,000.00	
	L&F CO LTD	4,327	238,000.00	1,029,826,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	38,301	14,910.00	571,067,910.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	299,000.00	806,104,000.00	
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,166	54,700.00	118,480,200.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	140,400.00	1,296,313,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	743,174	69,900.00	51,947,862,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	125,351	58,300.00	7,307,963,300.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	8,823	697,000.00	6,149,631,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	10,190.00	225,453,750.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	19,490.00	862,237,600.00	
	SK HYNIX INC	83,801	111,800.00	9,368,951,800.00	
		2,401,989		166,065,949,530.00	

韓国ウォン 小計				(18,184,221,473)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	111,240	79.90	8,888,076.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	43.95	19,961,035.20	
	CHINA STEEL	1,779,261	28.65	50,975,827.65	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	63.70	34,529,285.70	
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	82.00	49,021,568.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	68.70	52,950,662.40	
	TAIWAN CEMENT	913,419	37.30	34,070,528.70	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	977.00	18,130,189.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	32.05	11,602,997.40	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,870.00	16,830,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	41.20	20,691,175.60	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	26.25	12,206,250.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	39.80	15,362,800.00	
	EVERGREEN MARINE	183,215	108.00	19,787,220.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	31.05	14,655,600.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	56.70	4,231,804.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	50.60	10,980,200.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	38.75	6,861,113.75	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	495.00	19,768,815.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	194.50	13,702,136.00	
	GIANT MANUFACTURING	35,713	232.00	8,285,416.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	335.00	10,385,000.00	
	POU CHEN	273,780	30.95	8,473,491.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	53,000	769.00	40,757,000.00	
	MOMO.COM INC	6,000	670.00	4,020,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	283.00	25,057,952.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	73.20	56,832,114.00	
	PHARMAESSENTIA CORP	25,000	353.00	8,825,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	593,540	18.30	10,861,782.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,641,237	24.60	64,974,430.20	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,929,455	25.55	49,297,575.25	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,605,202	27.20	43,661,494.40	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	21.40	32,492,925.40	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,671,622	37.30	62,351,500.60	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,756,318	17.15	30,120,853.70	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,920,011	18.25	35,040,200.75	
	TAIWAN BUSINESS BANK	780,000	14.05	10,959,000.00	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,442,787	27.65	39,893,060.55	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	43.35	29,910,849.75	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	216,375	201.00	43,491,375.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,412,633	22.65	31,996,137.45	

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,531,057	42.25	64,687,158.25	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	11.90	30,657,089.40	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,110,906	60.00	66,654,360.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	8.62	16,652,684.92	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70,000	351.00	24,570,000.00	
ACER INC	617,803	31.30	19,337,233.90	
ADVANTECH CO LTD	76,261	374.50	28,559,744.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	293.00	37,237,956.00	
AUO CORP	1,268,072	18.40	23,332,524.80	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	172.50	20,475,750.00	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,390,080	15.35	21,337,728.00	
COMPAL ELECTRONICS	805,760	29.20	23,528,192.00	
DELTA ELECTRONICS INC	302,903	348.00	105,410,244.00	
E INK HOLDINGS INC	144,000	212.50	30,600,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,938,248	105.50	204,485,164.00	
INVENTEC CO LTD	280,511	44.60	12,510,790.60	
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,340.00	35,193,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	111.00	39,233,172.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	173.00	17,300,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	246.50	5,176,500.00	
PEGATRON CORP	340,474	70.50	24,003,417.00	
QUANTA COMPUTER INC	408,270	160.50	65,527,335.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	55.80	11,277,180.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	170.00	35,870,000.00	
WISTRON CORP	344,000	106.00	36,464,000.00	
WIWYNN CORP	16,000	1,505.00	24,080,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	260,692	56.10	14,624,821.20	
YAGEO CORPORATION	42,588	491.50	20,932,002.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	105.00	14,481,810.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	114.50	66,904,067.50	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	69.70	15,055,200.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	93.50	22,926,200.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	109.00	56,060,335.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,095.00	25,140,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,600.00	20,800,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	491.00	20,622,000.00	
MEDIATEK INC	241,804	682.00	164,910,328.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	69.10	17,896,900.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	435.50	41,827,597.50	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,010.00	8,080,000.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	30.15	17,366,400.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	383.00	23,724,552.00	

	SILERGY CORP	53,000	367.50	19,477,500.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,828,389	565.00	2,163,039,785.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,701,000	48.35	82,243,350.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	80.50	15,134,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	167.50	5,360,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	26.40	9,213,600.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	310,086	35.40	10,977,044.40	
新台湾ドル 小計		53,685,906		4,963,853,759.92 (22,587,520,149)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	93,550	391.75	36,648,212.50	
	COAL INDIA LTD	181,265	234.00	42,416,010.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	305.80	18,172,165.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	99.25	59,255,823.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	163.50	88,250,433.00	
	PETRONET LNG LTD	83,779	229.80	19,252,414.20	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	471,182	2,635.45	1,241,776,601.90	
	ACC LTD	14,288	1,789.65	25,570,519.20	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	417.85	30,725,764.05	
	ASIAN PAINTS LTD	56,921	3,344.05	190,346,670.05	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	673.60	19,836,846.40	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	1,744.85	81,734,008.55	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	179,650	422.35	75,875,177.50	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	610.75	42,614,470.50	
	JSW STEEL LTD	99,332	788.75	78,348,115.00	
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,760.60	48,124,398.20	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,612.40	76,177,584.00	
	SHREE CEMENT LTD	1,387	23,896.95	33,145,069.65	
	SRF LTD	19,164	2,223.65	42,614,028.60	
	TATA STEEL LTD	1,137,948	111.60	126,994,996.80	
	ULTRATECH CEMENT LTD	16,690	8,337.70	139,156,213.00	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	663.05	46,182,095.55	
	VEDANTA LTD	107,173	280.60	30,072,743.80	
	ABB LTD INDIA	5,256	4,397.10	23,111,157.60	
	ADANI ENTERPRISES LTD	23,002	2,379.00	54,721,758.00	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	123.95	62,892,849.75	
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	386.30	27,197,837.80	
	HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,284.25	45,804,060.50	
	HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	10,646	3,758.95	40,017,781.70	
	LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	2,448.50	263,434,115.00	
	SIEMENS INDIA LTD	11,025	3,686.90	40,648,072.50	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	630.30	14,492,487.90	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	718.75	75,168,312.50	

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	671.75	17,771,146.25	
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	2,630.05	69,567,452.55	
BAJAJ AUTO LTD	9,644	4,829.10	46,571,840.40	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,382.00	21,035,442.00	
BHARAT FORGE LTD	30,322	842.45	25,544,768.90	
EICHER MOTORS LTD	17,872	3,184.45	56,912,490.40	
HERO MOTOCORP LTD	13,719	3,147.45	43,179,866.55	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	150,112	1,563.80	234,745,145.60	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	21,329	9,850.50	210,101,314.50	
MRF LTD	432	101,187.70	43,713,086.40	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	91.35	47,614,817.25	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	535.35	31,740,366.15	
TATA MOTORS LTD	277,381	618.45	171,546,279.45	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	3,184.55	67,359,601.60	
TVS MOTOR CO LTD	41,254	1,322.05	54,539,850.70	
PAGE INDUSTRIES LTD	886	36,588.05	32,417,012.30	
TITAN CO LTD	56,531	3,144.75	177,775,862.25	
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	382.30	62,887,203.10	
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	493.20	21,666,276.00	
ZOMATO LTD	842,242	73.22	61,668,959.24	
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	4,403.05	63,210,185.80	
TRENT LTD	37,950	1,702.10	64,594,695.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	3,810.05	108,936,949.60	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	15,095	5,056.80	76,332,396.00	
ITC LTD	480,447	468.35	225,017,352.45	
MARICO LTD	81,711	516.05	42,166,961.55	
NESTLE INDIA LIMITED	5,146	22,882.20	117,751,801.20	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	833.25	77,691,396.75	
UNITED SPIRITS LTD	32,483	914.90	29,718,696.70	
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	820.90	65,965,882.20	
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	1,765.50	45,903,000.00	
DABUR INDIA LTD	79,726	572.25	45,623,203.50	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,062.60	67,364,589.60	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	129,502	2,696.35	349,182,717.70	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	5,152.90	75,036,529.80	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	609.65	73,274,443.15	
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	743.70	26,338,135.50	
CIPLA LTD	88,546	1,020.75	90,383,329.50	
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	3,670.25	80,495,923.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	5,182.30	94,944,918.30	
LUPIN LTD	26,552	901.10	23,926,007.20	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	145,156	1,035.50	150,309,038.00	

	TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,902.00	23,242,440.00	
	AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	761.05	22,933,480.70	
	AXIS BANK LTD	359,795	978.70	352,131,366.50	
	BANDHAN BANK LTD	74,811	230.45	17,240,194.95	
	BANK OF BARODA	248,313	208.90	51,872,585.70	
	ICICI BANK LTD	812,223	947.15	769,297,014.45	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	168,114	1,853.55	311,607,704.70	
	STATE BANK OF INDIA	268,868	593.75	159,640,375.00	
	YES BANK LTD	2,352,478	17.45	41,050,741.10	
	BAJAJ FINANCE LTD	44,172	7,621.35	336,650,272.20	
	BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,614.45	88,794,750.00	
	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	7,149.25	21,412,003.75	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	54,812	1,177.25	64,527,427.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	274,646	2,768.60	760,384,915.60	
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,267.95	15,751,742.85	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	836.60	50,777,437.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	38,585	1,718.10	66,292,888.50	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	140,130	658.30	92,247,579.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,335.80	44,924,289.80	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	572.45	25,941,144.20	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,293.45	94,080,379.20	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	139,039	1,157.05	160,875,074.95	
	INFOSYS LTD	513,793	1,331.15	683,935,551.95	
	LTIMINDTREE LTD	15,699	5,116.55	80,324,718.45	
	MPHASIS LTD	19,317	1,879.45	36,305,335.65	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	143,181	3,325.70	476,177,051.70	
	TATA ELXSI LTD	4,179	7,544.70	31,529,301.30	
	TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,155.25	109,514,234.25	
	WIPRO LTD	182,000	395.95	72,062,900.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	358,975	871.10	312,703,122.50	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	950.90	40,489,322.00	
	ADANI POWER LTD	85,623	243.85	20,879,168.55	
	GAIL INDIA LTD	504,548	110.50	55,752,554.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	495.10	13,231,052.40	
	NTPC LTD	664,141	192.55	127,880,349.55	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	600,735	255.60	153,547,866.00	
	TATA POWER CO LTD	199,512	227.85	45,458,809.20	
	DLF LTD	87,983	502.85	44,242,251.55	
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,579.70	20,100,102.80	
インドルピー 小計		17,718,213		12,629,115,226.79 (21,974,660,494)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	16.66	998,167.24	

	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.16	1,958,304.37	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.91	851,448.15	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	11.73	3,318,639.87	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	5.81	3,092,164.22	
	DUKHAN BANK	319,751	3.97	1,269,411.47	
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.53	2,896,617.93	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	9.92	2,129,883.62	
	QATAR ISLAMIC BANK	259,565	17.90	4,646,213.50	
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	16.17	11,986,853.34	
	OOREDOO QSC	72,800	11.70	851,760.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	17.30	1,669,657.60	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.57	535,116.71	
カタールリアル 小計		4,842,933		36,204,238.02 (1,418,482,045)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	165.17	5,651,621.89	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	191.82	2,813,999.40	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	823.20	8,224,591.20	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	67,443	381.97	25,761,202.71	
	GOLD FIELDS LTD	144,200	252.36	36,390,312.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	75.44	7,533,513.84	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	120.94	18,243,436.18	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	429.00	2,304,588.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	122.52	5,889,413.88	
	SASOL LTD	88,115	236.22	20,814,525.30	
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	29.05	11,472,542.20	
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	263.04	13,231,701.12	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	88.00	3,566,552.00	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	145.13	4,137,656.30	
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	3,209.47	98,180,896.77	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	16.38	7,789,967.64	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	94.00	3,530,076.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	73.55	12,968,041.80	
	BID CORP LTD	58,066	413.90	24,033,517.40	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	253.37	8,974,872.14	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	219.99	18,748,427.76	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	178.96	10,054,330.72	
	ABSA GROUP LTD	140,135	169.90	23,808,936.50	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	1,536.36	22,430,856.00	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	224.23	14,151,379.53	
	STANDARD BANK GROUP LTD	203,619	178.00	36,244,182.00	
	FIRSTRAND LTD	816,636	68.32	55,792,571.52	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	408.99	7,029,311.13	

	REMGRO LTD	74,679	150.44	11,234,708.76	
	DISCOVERY LIMITED	58,396	146.06	8,529,319.76	
	OLD MUTUAL LTD	974,656	12.06	11,754,351.36	
	OUTSURANCE GROUP LTD	72,133	34.86	2,514,556.38	
	SANLAM LTD	307,490	59.86	18,406,351.40	
	MTN GROUP LTD	255,377	133.93	34,202,641.61	
	VODACOM GROUP	79,334	114.54	9,086,916.36	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	63,952	110.00	7,034,720.00	
南アフリカランド 小計		5,273,289		612,536,588.56 (4,624,651,243)	
アラブ首長国連邦ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	3.32	1,725,224.72	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	3.95	1,704,211.70	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.96	1,758,327.12	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.11	3,823,297.30	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	10.76	1,999,003.56	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.50	2,888,292.00	
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	15.95	4,310,647.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	13.74	9,948,021.06	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	558,536	22.10	12,343,645.60	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.18	3,759,804.58	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	6.88	7,627,635.84	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		5,964,783		51,888,110.48 (2,016,890,854)	
クウェートディナール	AGILITY	323,386	0.63	205,350.11	
	BOUBYAN BANK K.S.C	162,047	0.65	106,140.78	
	GULF BANK	144,000	0.26	38,736.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,292,981	0.76	993,009.40	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,101,927	0.95	1,054,544.13	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.52	157,023.07	
	MABANEE CO KPSC	141,825	0.88	125,231.47	
クウェートディナール 小計		3,462,996		2,680,034.96 (1,247,181,068)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	6.13	899,271.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	28.70	2,554,300.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	14.04	898,560.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	6.86	613,970.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	7.73	773,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	19.13	1,840,306.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	8.16	1,940,382.72	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	9.05	720,380.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	17.27	170,973.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	25.21	705,880.00	

YANZHOU COAL MINING CO-A	20,700	33.09	684,963.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	6.06	995,658.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	23.44	690,073.60	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	5.71	2,109,845.00	
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,930	34.30	717,899.00	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	30.71	632,626.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	13.44	1,239,168.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	25.20	524,160.00	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10,300	57.90	596,370.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	60.90	682,080.00	
GEM CO LTD-A	289,800	6.96	2,017,008.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	40.34	1,001,480.84	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	14.51	538,321.00	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	6.77	998,575.00	
HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.26	1,880,546.00	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	2,400	68.36	164,064.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	12.26	122,600.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.85	852,850.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.32	259,200.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	11.79	262,917.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	86.92	677,976.00	
LB GROUP CO LTD-A	15,300	16.11	246,483.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	14.83	698,493.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	12.75	1,009,800.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	4.13	80,535.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	18.97	902,972.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	11.61	562,504.50	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	15.01	832,679.75	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	23.47	170,204.44	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	31.61	567,083.40	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.09	885,594.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	38.21	620,530.40	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	7.62	835,746.36	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.95	542,730.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	13.39	660,127.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	49.30	532,440.00	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	960	115.86	111,225.60	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	20.35	1,015,465.00	
SKSHU PAINT CO LTD-A	9,940	61.80	614,292.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	68.51	781,014.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	13.45	131,810.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.02	1,001,432.00	

WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	85.41	3,442,023.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	30.15	444,772.80	
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	53.85	887,717.25	
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	62.00	112,840.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	91.80	376,380.00	
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	22.81	853,094.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	43.98	325,891.80	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	13.10	1,695,140.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	11.55	3,108,105.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	41.78	476,292.00	
AVICOPTER PLC-A	15,500	39.31	609,305.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	24.86	208,824.00	
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	11.69	748,160.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	30.95	1,708,904.25	
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.37	1,429,347.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	8.28	1,905,228.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.64	3,171,936.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	39,780	222.25	8,841,105.00	
CRRC CORP LTD-A	185,800	6.63	1,231,854.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	19.02	821,664.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	56.89	2,245,618.97	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	6.25	142,500.00	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	96.53	231,672.00	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	10.64	213,981.04	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,770	163.60	616,772.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	26.69	154,802.00	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	51.85	326,655.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	32.66	859,611.20	
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	7,434	49.49	367,908.66	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	64.66	740,744.96	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	15.62	641,982.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	15.07	724,867.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	4.05	1,340,145.00	
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	16.50	597,300.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	23.50	1,973,530.00	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	154.40	917,136.00	
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	47.95	601,005.30	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	53.83	628,465.25	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	17.75	717,100.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.80	946,560.00	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	193.10	531,411.20	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	16.54	693,026.00	

SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.56	2,219,352.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	67.21	1,908,293.53	
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	9.92	248,595.20	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	115.60	1,156,000.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	16.09	654,863.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	157.70	645,939.20	
TBEA CO LTD-A	22,519	21.89	492,940.91	
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	12.65	546,480.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.57	1,310,058.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	27.33	863,628.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	57.42	474,289.20	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	28.17	205,641.00	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	8.14	734,228.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.71	537,471.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	42.36	465,960.00	
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.77	227,143.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.49	2,180,079.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.03	201,200.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	10.01	1,836,835.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.56	1,213,380.00	
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	45.09	2,394,279.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	46.50	247,333.50	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.25	233,100.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	15.03	837,171.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	9.55	208,572.00	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	10,800	88.81	959,148.00	
BYD CO LTD -A	17,000	264.40	4,494,800.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	134.60	1,211,400.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	13.83	599,558.16	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	35.80	662,300.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	18.51	634,893.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	159.86	1,342,824.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	18.74	549,082.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	74.82	52,374.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.41	613,866.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	22.68	890,280.72	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	75.96	212,688.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	36.48	1,586,880.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	25.00	694,000.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	38.89	308,475.48	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	91.30	703,010.00	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	22.86	2,311,146.00	

TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	4.16	466,752.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	52.01	416,080.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	45.08	1,181,096.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	4.47	354,471.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	12.67	424,191.60	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	30.25	741,125.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	7.98	427,728.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.77	943,738.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	443.80	1,287,020.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	2,800	15.98	44,744.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	33.31	542,953.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	15.59	355,452.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	7.00	430,500.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	109.66	2,272,155.20	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	6.78	749,190.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	27.23	606,983.93	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	14,196	36.74	521,561.04	
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	35.74	382,418.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	247.00	395,200.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	50.45	110,990.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	60.91	1,114,653.00	
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	149.77	449,310.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	6.95	413,525.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	86.13	680,427.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	5,980	17.78	106,324.40	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	45.79	2,475,270.03	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	19.16	524,984.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	47.12	801,040.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	24.32	1,911,065.60	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	28.68	983,781.36	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	52.19	902,887.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	130.28	1,185,548.00	
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	91.86	514,416.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	37.04	425,960.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	33.82	236,740.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	11,500	1,690.03	19,435,345.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	211.35	3,888,840.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	41.68	1,398,697.44	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	11.89	318,652.00	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	36.23	1,818,746.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	198.10	1,858,178.00	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	59.90	682,860.00	

TOLY BREAD CO LTD-A	147,600	9.98	1,473,048.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	18.43	703,288.80	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	163.66	6,791,890.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	40.02	404,202.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	15.73	83,369.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	20.89	620,433.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	17.81	1,634,049.69	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	31.39	502,240.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	73.99	209,983.62	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	45.61	443,329.20	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	22.25	274,787.50	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	15,496	9.66	149,691.36	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	22.08	326,784.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	6.95	172,638.00	
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	31.10	224,199.90	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	7,900	291.64	2,303,956.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	100.00	200,000.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	119.13	33,356.40	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	83,180	25.78	2,144,380.40	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	53.58	1,521,672.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	63.73	668,336.51	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	52.01	837,361.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	58.95	324,225.00	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	91.08	825,822.36	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	141.71	311,762.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	55.25	563,550.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	41.82	621,027.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	49.17	1,091,229.81	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	62.93	503,440.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	21.92	413,192.00	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	454.77	945,921.60	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	39,102	48.39	1,892,145.78	
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	11,116	40.31	448,085.96	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	13.25	366,786.50	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	39.02	744,423.56	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.36	471,776.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	25.14	273,523.20	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	32.70	228,900.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	24.88	234,867.20	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	28.62	321,459.84	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	25.17	427,890.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	16,464	63.01	1,037,396.64	

YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	52.02	517,078.80	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	3,900	281.19	1,096,641.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	18.17	163,893.40	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	66,500	26.10	1,735,650.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	15.30	533,174.40	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	33.43	324,271.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	3.52	3,632,992.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.38	254,040.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	12.22	1,923,428.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	5.75	2,943,425.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	11.69	1,317,463.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.29	1,674,804.60	
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	7.98	1,177,050.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	24.74	1,442,342.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	5.77	262,535.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.19	773,131.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.06	2,556,018.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	32.31	6,009,660.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.77	1,031,472.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.63	1,055,103.40	
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.37	641,178.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	4.76	2,754,136.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	15.52	3,189,360.00	
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	11.20	1,337,280.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.88	690,520.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	7.22	3,157,306.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.89	476,525.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	10.58	840,052.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.37	422,522.10	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.88	117,012.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.18	382,006.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.91	398,660.60	
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	20.13	2,839,940.40	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	24.27	584,907.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	14.02	1,646,326.54	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	16.40	59,040.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.71	343,742.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	14.83	898,698.00	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	6.45	1,107,329.55	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	8.93	2,010,143.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.38	1,039,674.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.68	1,015,694.00	

HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	165.25	892,350.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	14.21	447,615.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.28	717,615.60	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	9.95	403,731.20	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.61	955,192.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	7.48	2,300,848.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.69	420,660.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	9.99	436,563.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	6.89	2,168,972.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	27.47	2,752,494.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	47.21	4,947,608.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	12.20	328,180.00	
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	4,100	33.16	135,956.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	447.00	2,155,881.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	34,398	13.25	455,773.50	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	50.60	1,632,659.60	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.81	379,317.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	41.57	688,482.34	
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	68.61	740,988.00	
NAVINFO CO LTD-A	33,200	11.76	390,432.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	108.29	324,870.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	9,531	49.10	467,972.10	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	101.12	556,160.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	19.94	262,609.80	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	24.72	936,888.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	4.32	495,072.00	
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	20,100	26.92	541,092.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	30.37	850,360.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	14.15	492,420.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	92.58	842,478.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	23.66	1,067,066.00	
GOERTEK INC -A	26,900	18.52	498,188.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	6.61	330,500.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	63.83	446,810.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	46.02	907,146.24	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	12.11	203,448.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	33.31	1,547,249.50	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	107.30	185,414.40	
NINESTAR CORP-A	18,543	35.06	650,117.58	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	15.00	364,500.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	75.68	360,236.80	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	141.86	912,869.10	

SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	25.61	729,885.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.41	442,270.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	18,340	30.61	561,387.40	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	48.55	203,910.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	7.78	417,863.80	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	134.67	632,949.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	33.80	532,350.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	20.84	631,452.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	146.99	1,278,813.00	
ZTE CORP-A	76,400	42.99	3,284,436.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.69	1,982,932.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	7.38	1,282,644.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	5.35	1,290,955.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	22.00	3,957,360.00	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	18.76	1,043,056.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	3.76	1,187,032.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	12.29	2,174,101.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	14.50	1,338,350.00	
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	149.33	1,059,795.01	
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	85.21	863,858.98	
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	195.43	2,232,201.46	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	53.55	1,126,263.60	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	105.21	659,877.12	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	21,168	35.19	744,901.92	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	30.73	230,475.00	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	88.79	665,925.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	36.16	1,236,744.32	
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	30.75	916,350.00	
JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	12.52	287,784.72	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	27.36	2,745,302.40	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	63.70	1,341,203.50	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	285.14	883,934.00	
SG MICRO CORP-A	4,095	81.66	334,397.70	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	106.30	839,770.00	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	225.98	632,744.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	30.31	1,117,681.25	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	9.28	303,920.00	
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	22.44	504,137.04	
TONGWEI CO LTD-A	31,600	32.20	1,017,520.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	37.79	960,546.22	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	93.08	638,435.72	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	105.18	766,762.20	

	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	42.87	608,754.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	67.10	1,142,176.20	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	12.62	690,314.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	13.87	744,819.00	
	GEMDALE CORP-A	45,500	7.02	319,410.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	4.05	2,117,340.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	12.80	1,047,040.00	
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	13.95	178,560.00	
オフショア人民元 小計		25,674,347		363,503,218.73 (7,162,830,925)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	11.40	512,304.60	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	416,274	32.30	13,445,650.20	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	46.15	543,416.25	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	15.12	482,751.36	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	131.60	4,923,550.80	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	37.45	1,769,175.45	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	43.60	9,192,798.40	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	145.00	1,355,605.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	143,934	89.30	12,853,306.20	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	25.75	2,197,067.25	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	13.44	1,390,112.64	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	49.50	2,528,410.50	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	180.80	760,625.60	
	JARIR MARKETING CO	125,000	16.32	2,040,000.00	
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	171.80	1,104,845.80	
	ALMARAI CO	30,130	65.20	1,964,476.00	
	SAVOLA	36,289	41.00	1,487,849.00	
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	157.60	1,076,880.80	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	290.00	3,397,930.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	239.60	1,907,695.20	
	AL RAJHI BANK	291,473	72.50	21,131,792.50	
	ALINMA BANK	161,322	35.00	5,646,270.00	
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	26.65	2,292,726.15	
	BANK AL-JAZIRA	97,894	18.30	1,791,460.20	
	BANK ALBILAD	89,702	38.60	3,462,497.20	
	BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	42.40	4,021,004.00	
	RIYAD BANK	234,479	33.35	7,819,874.65	
	SAUDI AWWAL BANK	147,895	39.55	5,849,247.25	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	17.18	1,213,595.20	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	437,009	36.75	16,060,080.75	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	198.40	2,173,868.80	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	186.00	2,645,478.00	

	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	324.80	1,434,641.60	
	ELM CO	2,436	580.80	1,414,828.80	
	ETIHAD ETISALAT CO	48,844	47.40	2,315,205.60	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	13.80	1,249,010.40	
	SAUDI TELECOM CO	301,319	44.60	13,438,827.40	
	ACWA POWER CO	16,922	176.80	2,991,809.60	
	SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	23.02	3,731,749.18	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	15.94	1,609,796.54	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.37	432,772.19	
サウジアラビアリアル 小計		3,932,292		167,660,987.06 (6,379,500,557)	
合　計		1,304,697,261		146,874,045,514 (146,874,045,514)	

(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	97,360	13,645,977.60	
	メキシコペソ 小計		97,360	13,645,977.60 (113,499,054)	
	ブラジルレアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	6,451,663.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,368,738.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,895,058.00	
		KLABIN SA-UNIT	100,000	2,187,000.00	
	ブラジルレアル 小計		383,600	11,902,459.00 (348,115,979)	
投資信託受益証券合計			480,960	461,615,033 (461,615,033)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	9,788,583.00	
	メキシコペソ 小計		391,700	9,788,583.00 (81,415,560)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	5,601,176.10	
	南アフリカランド 小計		478,733	5,601,176.10 (42,288,879)	
投資証券合計			870,433	123,704,439 (123,704,439)	
合計				585,319,472 (585,319,472)	

(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　34銘柄	100.0%	—	—	2.4%
メキシコペソ	株式　21銘柄	95.4%	—	—	2.7%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	2.7%	—	0.1%
	投資証券　1銘柄	—	—	1.9%	0.1%
ブラジルレアル	株式　43銘柄	95.7%	—	—	5.3%
	投資信託受益証券　4銘柄	—	4.3%	—	0.2%
チリペソ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	0.6%
コロンビアペソ	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.1%
ユーロ	株式　10銘柄	100.0%	—	—	0.5%
トルコリラ	株式　18銘柄	100.0%	—	—	0.6%
チェココルナ	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ハンガリーフォリント	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ポーランドズロチ	株式　14銘柄	100.0%	—	—	0.8%
ロシアルーブル	株式　14銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式　196銘柄	100.0%	—	—	22.3%
マレーシアリンギット	株式　33銘柄	100.0%	—	—	1.3%
タイバーツ	株式　42銘柄	100.0%	—	—	1.9%
フィリピンペソ	株式　15銘柄	100.0%	—	—	0.6%
インドネシアルピア	株式　22銘柄	100.0%	—	—	2.0%
韓国ウォン	株式　101銘柄	100.0%	—	—	12.3%
新台湾ドル	株式　90銘柄	100.0%	—	—	15.3%
インドルピー	株式　114銘柄	100.0%	—	—	14.9%
カタールリアル	株式　13銘柄	100.0%	—	—	1.0%
南アフリカランド	株式　36銘柄	99.1%	—	—	3.1%
	投資証券　1銘柄	—	—	0.9%	0.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式　11銘柄	100.0%	—	—	1.4%
クウェートディナール	株式　7銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オフショア人民元	株式　354銘柄	100.0%	—	—	4.9%
サウジアラビアリアル	株式　41銘柄	100.0%	—	—	4.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,964,354,157
投資証券	131,964,315,500
未収入金	19,592,918
未収配当金	1,064,544,337
前払金	15,630,100
差入委託証拠金	238,123,000
流動資産合計	136,266,560,012
資産合計	136,266,560,012
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,630,100
未払金	368,668,348
未払解約金	17,445,217
未払利息	2,471
流動負債合計	401,746,136
負債合計	401,746,136
純資産の部	
元本等	
元本	64,657,212,453
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	71,207,601,423
元本等合計	135,864,813,876
純資産合計	135,864,813,876
負債純資産合計	136,266,560,012

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10日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

	2023年 7月10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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	64,657,212,453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 2.1013円 (1万口当たり純資産額) (21,013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 7月10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 7月10日現在
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	54,153,941,017円
期中追加設定元本額	15,858,231,600円
期中一部解約元本額	5,354,960,164円
期末元本額	64,657,212,453円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,922,458,640円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,180,330円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	16,948,186,166円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	34,387,033,594円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,403,182,278円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,164,268,574円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,060,652,310円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,827,718,193円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,021,696,978円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	24,382,353円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	247,976,186円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	10,608,403円
グローバル経済コア	271,838,832円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	14,600,825円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	637,380,154円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	143,632,814円
Ｍｙ　ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	419,567,927円
１０資産分散投資ファンド	23,169,915円
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	506,856,886円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,174,141円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	455,057,747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）	95,554,811円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	519,109,269円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－１１（適格機関投資家専用）	250,858,758円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１９－０３（適格機関投資家専用）	286,066,369円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	△5,615,313,365
合計	△5,615,313,365

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	3,865,460,100	－	3,849,830,000	△15,630,100
合計		3,865,460,100	－	3,849,830,000	△15,630,100

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,560	310,528,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	4,034	369,514,400	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	6,264	815,572,800	
	東海道リート投資法人	2,094	268,450,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,349	2,813,803,000	

森ヒルズリート投資法人	14,809	2,190,251,100	
産業ファンド投資法人	19,215	2,876,485,500	
アドバンス・レジデンス投資法人	12,592	4,186,840,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	9,236	2,137,210,400	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,607	2,669,228,000	
ＧＬＰ投資法人	42,460	5,867,972,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	6,022	2,086,623,000	
日本プロロジスリート投資法人	21,897	6,319,474,200	
星野リゾート・リート投資法人	2,203	1,370,266,000	
Ｏｎｅリート投資法人	2,197	552,765,200	
イオンリート投資法人	14,458	2,232,315,200	
ヒューリックリート投資法人	11,783	1,889,993,200	
日本リート投資法人	4,091	1,413,440,500	
積水ハウス・リート投資法人	37,843	3,133,400,400	
トーセイ・リート投資法人	2,794	375,513,600	
ケネディクス商業リート投資法人	5,475	1,595,962,500	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	3,105	497,110,500	
サムティ・レジデンシャル投資法人	3,274	391,570,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	40,726	6,601,684,600	
いちごホテルリート投資法人	2,086	214,649,400	
ラサールロジポート投資法人	16,098	2,462,994,000	
スターアジア不動産投資法人	15,724	922,998,800	
マリモ地方創生リート投資法人	1,924	245,117,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,975	2,437,750,000	
大江戸温泉リート投資法人	2,033	129,095,500	
投資法人みらい	15,300	711,450,000	
三菱地所物流リート投資法人	4,327	1,741,617,500	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	5,396	957,790,000	
ザイマックス・リート投資法人	2,043	236,375,100	
タカラレーベン不動産投資法人	5,937	571,139,400	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,489	730,585,900	
日本ビルファンド投資法人	14,692	8,609,512,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	12,914	7,154,356,000	
日本都市ファンド投資法人	63,542	6,112,740,400	
オリックス不動産投資法人	25,093	4,343,598,300	
日本プライムリアルティ投資法人	8,613	3,053,308,500	
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	12,106	1,619,782,800	
東急リアル・エステート投資法人	8,444	1,595,916,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	9,268	1,066,746,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	28,171	4,098,880,500	
森トラストリート投資法人	23,440	1,680,648,000	
インヴィンシブル投資法人	55,430	3,059,736,000	

	フロンティア不動産投資法人	4,673	2,184,627,500	
	平和不動産リート投資法人	8,873	1,291,021,500	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	8,492	2,611,290,000	
	福岡リート投資法人	6,513	1,066,178,100	
	ケネディクス・オフィス投資法人	7,328	2,539,152,000	
	いちごオフィスリート投資法人	10,319	921,486,700	
	大和証券オフィス投資法人	2,609	1,651,497,000	
	阪急阪神リート投資法人	5,688	814,521,600	
	スターツプロシード投資法人	2,183	490,301,800	
	大和ハウスリート投資法人	18,983	5,216,528,400	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	40,612	3,001,226,800	
	大和証券リビング投資法人	17,451	1,984,178,700	
	ジャパンエクセレント投資法人	11,553	1,469,541,600	
合計		768,410	131,964,315,500	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	297,236,645
コール・ローン	1,934,249,115
投資証券	90,340,824,295
派生商品評価勘定	1,161,757
未収入金	12,897,302
未収配当金	388,840,059
流動資産合計	92,975,209,173
資産合計	92,975,209,173
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,036,464,987
未払利息	1,612
流動負債合計	2,036,466,599
負債合計	2,036,466,599
純資産の部	
元本等	

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
元本	35,682,145,567
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	55,256,597,007
元本等合計	90,938,742,574
純資産合計	90,938,742,574
負債純資産合計	92,975,209,173

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10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	35,682,145,567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 2.5486円 (1万口当たり純資産額) (25,486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 7月10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 7月10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

	2023年 7月10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。 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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	39,468,176,591円
期中追加設定元本額	7,193,145,137円
期中一部解約元本額	10,979,176,161円
期末元本額	35,682,145,567円
期末元本額の内訳	
グローバル３資産バランスオープン	57,018,047円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	100,877,861円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,577,901,981円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,188,754円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	12,175,977,780円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	13,807,710,095円
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,133,064円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,090,366,067円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,144,609,846円

区分	2023年 7月10日現在
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,578,869,574円
コア投資戦略ファンド（切替型）	510,318,247円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	113,388,333円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	176,477,358円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	9,243,558円
グローバル経済コア	230,347,318円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	13,807,762円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	345,064,516円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	76,629,281円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	151,565,868円
１０資産分散投資ファンド	12,821,000円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,160,472,703円
ＦＯＦｓ用　グローバルＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	182,535,189円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	82,092,434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）	57,560,119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）	37,829,136円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０１（適格機関投資家専用）	101,254,666円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－０８（適格機関投資家専用）	98,602,587円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２０－１１（適格機関投資家専用）	98,102,805円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	98,563,944円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０７（適格機関投資家専用）	97,589,221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）	72,650,022円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２３－０２（適格機関投資家専用）	63,576,431円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	2,208,610,013
合計	2,208,610,013

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	111,860,280	－	110,698,523	1,161,757
	アメリカドル	108,045,000	－	106,888,575	1,156,425
	オーストラリアドル	3,815,280	－	3,809,948	5,332
合計		111,860,280	－	110,698,523	1,161,757

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	48,737	710,098.09	
		AGREE REALTY CORP	47,425	3,087,841.75	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	36,043	665,714.21	
		ALEXANDER'S INC	886	162,155.72	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	78,187	9,148,660.87	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	92,283.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	29,042	573,289.08	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	155,862	5,618,825.10	
		AMERICOLD REALTY TRUST	133,901	4,233,949.62	
		APARTMENT INCOME REIT CO	73,779	2,658,257.37	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	69,944	592,425.68	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	104,891	1,602,734.48	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	32,051	381,086.39	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	66,980.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	70,567	13,483,236.69	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,856	30,067.20	
		BOSTON PROPERTIES	70,725	4,178,433.00	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	113,652.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	81,217	377,659.05	

		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	148,786	3,255,437.68	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	95,237	1,469,506.91	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	100,450.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	52,967	5,761,750.26	
		CARETRUST REIT INC	52,232	1,018,524.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	11,597	257,685.34	
		CENTERSPACE	7,349	458,871.56	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,562	245,139.58	
		CITY OFFICE REIT INC	15,298	87,351.58	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	42,486.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,050	382,551.00	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	59,276	1,449,890.96	
		COUSINS PROPERTIES INC	74,825	1,735,191.75	
		CTO REALTY GROWTH INC	8,400	145,824.00	
		CUBESMART	111,419	4,933,633.32	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	112,866	917,600.58	
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	85,824.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	144,817	16,480,174.60	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	284,992.00	
		DOUGLAS EMMETT INC-W/I	82,382	1,119,571.38	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	49,311	719,447.49	
		EASTGROUP PROPERTIES,INC	21,994	3,815,959.00	
		ELME COMMUNITIES	40,527	665,453.34	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	62,623	499,105.31	
		EPR PROPERTIES	38,177	1,798,900.24	
		EQUINIX INC	46,511	35,920,910.41	
		EQUITY COMMONWEALTH	57,330	1,165,518.90	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	86,840	5,724,492.80	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	169,422	11,273,339.88	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	74,641	1,740,628.12	
		ESSEX PROPERTY TRUST	31,863	7,432,044.75	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	67,080	9,935,889.60	
		FARMLAND PARTNERS INC	22,851	281,524.32	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	36,331	3,487,049.38	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	66,879	3,551,943.69	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	42,562	1,078,521.08	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	71,717.88	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	130,342	6,249,898.90	
		GETTY REALTY CORP	22,990	749,244.10	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	256,711.00	
		GLADSTONE LAND CORP	15,061	244,741.25	

GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,431	245,279.68	
GLOBAL NET LEASE INC	49,084	522,744.60	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	190,423	3,560,910.10	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	271,357	5,576,386.35	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,211	121,029.30	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	53,689	1,337,392.99	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	352,929	6,158,611.05	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,023	306,335.46	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	111,096	1,979,730.72	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	125,367.48	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	14,642	1,063,887.72	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	32,229	753,514.02	
INVITATION HOMES INC	288,771	10,031,904.54	
IRON MOUNTAIN INC	144,804	8,391,391.80	
JBG SMITH PROPERTIES	46,081	723,010.89	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	118,231.50	
KILROY REALTY CORPORATION	52,622	1,672,853.38	
KIMCO REALTY CORP	307,605	6,121,339.50	
KITE REALTY GROUP TRUST	108,393	2,407,408.53	
LIFE STORAGE INC	42,213	5,576,759.43	
LTC PROPERTIES INC	22,125	727,912.50	
LXP INDUSTRIAL TRUST	144,466	1,404,209.52	
MACERICH CO/THE	112,250	1,272,915.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	141,142.71	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	295,942	2,740,422.92	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	57,929	8,872,984.93	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	43,098	1,518,773.52	
NATL HEALTH INVESTORS INC	23,139	1,209,012.75	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	63,086	444,125.44	
NETSTREIT CORP	27,610	479,585.70	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	15,490	195,793.60	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,806	502,479.00	
NNN REIT INC	90,208	3,814,896.32	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	181,210.20	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	116,063	3,593,310.48	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	176,709.45	
ORION OFFICE REIT INC	34,844	240,423.60	
PARAMOUNT GROUP INC	80,008	395,239.52	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	109,726	1,460,453.06	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	62,648	891,481.04	
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	57,873	1,915,596.30	

		PHYSICIANS REALTY TRUST	119,855	1,663,587.40	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	58,412	442,178.84	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,962	407,557.78	
		POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	103,530.00	
		PRIME US REIT	295,000	64,900.00	
		PROLOGIS INC	459,352	56,036,350.48	
		PUBLIC STORAGE	78,668	22,584,796.12	
		REALTY INCOME CORP	334,695	19,937,781.15	
		REGENCY CENTERS CORP	77,230	4,734,971.30	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	66,925	904,156.75	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	99,666	5,143,762.26	
		RLJ LODGING TRUST	76,182	794,578.26	
		RPT REALTY	39,523	410,643.97	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,109	2,840,181.97	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	117,928	1,397,446.80	
		SAFEHOLD INC	21,624	535,410.24	
		SAUL CENTERS INC	6,846	247,140.60	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	89,293	781,313.75	
		SIMON PROPERTY GROUP	162,551	19,270,421.05	
		SITE CENTERS CORP	87,704	1,169,971.36	
		SL GREEN REALTY CORP	31,274	984,192.78	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	71,857	2,820,387.25	
		STAG INDUSTRIAL INC	88,787	3,185,677.56	
		STAR HOLDINGS	6,183	94,167.09	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	350,131.70	
		SUN COMMUNITIES INC	61,768	8,141,640.08	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100,395	1,035,072.45	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	50,538	1,104,255.30	
		TERRENO REALTY CORP	37,611	2,196,106.29	
		UDR INC	153,571	6,549,803.15	
		UMH PROPERTIES INC	25,129	406,838.51	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,281	298,849.98	
		URBAN EDGE PROPERTIES	57,394	895,346.40	
		URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	317,555.00	
		VENTAS INC	198,700	9,517,730.00	
		VERIS RESIDENTIAL INC	43,050	703,006.50	
		VICI PROPERTIES INC	499,155	15,538,695.15	
		VORNADO REALTY TRUST	80,077	1,481,424.50	
		WELLTOWER INC	247,098	19,720,891.38	
		WHITESTONE REIT	23,074	223,587.06	
		WP CAREY INC	106,177	7,182,874.05	

	XENIA HOTELS & RESORTS INC	54,932	708,073.48	
アメリカドル 小計		12,893,011	496,572,599.60 (70,781,458,346)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	29,679	639,582.45	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	215,343.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	136,560.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,093	695,087.38	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	164,540.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	64,200.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	40,850	2,029,836.50	
	CHOICE PROPERTIES REIT	82,975	1,093,610.50	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	369,420.30	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	413,731.60	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	66,102	940,631.46	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,339	69,460.39	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	67,876.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	49,125	703,470.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,135	1,352,294.20	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	61,841	627,686.15	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	29,406.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,790	422,712.90	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,096	504,524.64	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	165,279.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	6,956	116,513.00	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	134,365.85	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	376,192.08	
	PRIMARIS REIT	22,050	290,178.00	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	84,480.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	70,438	1,343,252.66	
	SLATE GROCERY REIT	8,419	110,709.85	
	SLATE OFFICE REI	17,000	34,000.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	35,154	839,125.98	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	60,888.00	
カナダドル 小計		873,566	14,094,957.89 (1,512,388,981)	
ユーロ	AEDIFICA	23,987	1,444,017.40	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	36,720.00	
	ALTAREA	1,959	200,993.40	

		CARE PROPERTY INVEST	17,887	221,441.06	
		CARMILA	26,392	371,599.36	
		COFINIMMO	14,398	1,001,380.90	
		COVIVIO(FP)	23,027	1,009,043.14	
		CROMWELL REIT EUR	170,400	265,824.00	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,490	449,960.40	
		GECINA SA	27,070	2,558,115.00	
		HAMBORNER REIT AG	37,000	233,840.00	
		ICADE	17,300	613,458.00	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	81,264.95	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	153,184	814,172.96	
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	166,738.00	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	196,560.00	
		KLEPIERRE	96,595	2,162,762.05	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	193,120.00	
		MERCIALYS	36,384	305,807.52	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	166,888	1,312,574.12	
		MONTEA NV	6,890	486,434.00	
		NSI NV	7,359	149,387.70	
		RETAIL ESTATES	5,335	311,030.50	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	54,250	2,685,917.50	
		VASTNED RETAIL	10,650	210,870.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	78,709	2,081,065.96	
		WERELDHAVE NV	22,376	329,822.24	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	12,191	326,109.25	
	ユーロ 小計		1,327,811	20,220,029.41 (3,160,390,596)	
	イギリスポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	123,848	59,447.04	
		AEW UK REIT PLC	68,000	64,804.00	
		ASSURA PLC	1,556,822	691,851.69	
		BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	247,852.00	
		BIG YELLOW GROUP PLC	87,773	894,406.87	
		BRITISH LAND CO PLC	468,934	1,420,870.02	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	115,067	91,823.46	
		CLS HOLDINGS PLC	75,636	104,528.95	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	195,386.18	
		DERWENT LONDON PLC	56,125	1,144,950.00	
		EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	63,800.00	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	260,712.00	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	121,885	498,022.11	
		HAMMERSON PLC	1,931,365	475,502.06	

		HELICAL PLC	45,400	118,721.00	
		HOME REIT PLC	374,236	142,396.79	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	162,293	142,817.84	
		INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	371,925	2,128,154.85	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	499,236	819,246.27	
		LXI REIT PLC	834,609	694,811.99	
		NEWRIVER REIT PL	126,000	106,722.00	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	184,116.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	690,955	637,060.51	
		PRS REIT PLC/THE	260,002	210,341.61	
		REGIONAL REIT LTD	222,000	98,679.00	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	107,256	896,660.16	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	86,430.00	
		SEGRO PLC	608,940	4,321,038.24	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	950,577	1,059,893.35	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	675,749	477,078.79	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	107,538.29	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	932,234	1,169,021.43	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	405,972	198,926.28	
		UNITE GROUP PLC	197,900	1,676,213.00	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	223,421	243,975.73	
		WAREHOUSE REIT PLC	237,876	186,732.66	
		WORKSPACE GROUP PLC	65,316	302,674.34	
	イギリスポンド 小計		14,834,274	22,232,476.51 (4,064,541,355)	
	オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	194,329	503,312.11	
		ARENA REIT	192,648	685,826.88	
		BWP TRUST	237,407	845,168.92	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	348,575	557,720.00	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	270,296	832,511.68	
		CENTURIA OFFICE REIT	203,929	283,461.31	
		CHARTER HALL GROUP	231,682	2,497,531.96	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	330,964	1,313,927.08	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	275,874	982,111.44	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	157,784	449,684.40	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	368,192.00	
		DEXUS	543,275	4,253,843.25	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	305,100.00	
		GDI PROPERTY GROUP	185,597	122,494.02	
		GOODMAN GROUP	851,459	16,705,625.58	
		GPT GROUP	953,138	3,879,271.66	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	380,339.40	

	HEALTHCO REIT	194,021	260,958.24	
	HMC CAPITAL LTD	122,191	592,626.35	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	736,165	842,908.92	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	316,334.48	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	173,646	635,544.36	
	MIRVAC GROUP	1,987,126	4,451,162.24	
	NATIONAL STORAGE REIT	603,590	1,370,149.30	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	131,541.60	
	REGION RE GROUP	588,421	1,318,063.04	
	RURAL FUNDS GROUP	181,331	343,622.24	
	SCENTRE GROUP	2,581,713	6,738,270.93	
	STOCKLAND	1,191,357	4,705,860.15	
	VICINITY CENTERS	1,891,583	3,414,307.31	
	WAYPOINT REIT LTD	336,956	845,759.56	
オーストラリアドル 小計		16,779,653	60,933,230.41 (5,804,499,528)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	488,215.26	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	556,435	1,235,285.70	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	743,753	680,533.99	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	651,295	843,427.02	
	STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	432,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	241,387	567,259.45	
ニュージーランドドル 小計		2,910,148	4,246,721.42 (375,367,706)	
香港ドル	CHAMPION REIT	927,000	2,586,330.00	
	FORTUNE REIT	735,000	4,152,750.00	
	LINK REIT	1,268,300	53,205,185.00	
	PROSPERITY REIT	492,000	826,560.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,660,560.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	2,051,456.20	
香港ドル 小計		5,289,960	64,482,841.20 (1,174,232,538)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	335,500.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,640,718	4,380,717.06	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,092,277	1,157,813.62	
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	640,004.89	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,559,744	4,761,123.84	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	461,564.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400	195,398.00	
	EC WORLD REIT	180,000	54,000.00	
	ESR-LOGOS REIT	3,029,264	1,029,949.76	

		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	334,800.00	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	137,215.50	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	529,862	1,133,904.68	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	1,448,796	1,767,531.12	
		KEPPEL DC REIT	661,303	1,415,188.42	
		KEPPEL REIT	1,047,300	942,570.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	871,250	570,668.75	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,029,063	2,243,357.34	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,642,585	2,644,561.85	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	1,142,873	1,817,168.07	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	388,461.42	
		PARAGON REIT	519,600	491,022.00	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	197,500	750,500.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	208,539.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	663,000	338,130.00	
		SUNTEC REIT	1,134,100	1,428,966.00	
	シンガポールドル 小計		23,681,300	29,628,655.32 (3,135,304,305)	
	韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	90,650,400.00	
		E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	66,792,000.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	316,005,900.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	50,075,850.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS	4,501	490,609.00	
		JR REIT XXVII	76,683	312,866,640.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	142,933,460.00	
		LOTTE REIT CO LTD	72,480	263,464,800.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	177,383,500.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	49,406,445.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	36,380	224,464,600.00	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	46,579,280.00	
		SK REITS CO LTD	39,229	199,283,320.00	
	韓国ウォン 小計		460,839	1,940,396,804.00 (212,473,450)	
	イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	591,480.00	
		REIT 1 LTD	103,500	1,656,000.00	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	867,790.00	
	イスラエルシェケル 小計		578,500	3,115,270.00 (120,167,490)	
合計			79,629,062	90,340,824,295 (90,340,824,295)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券　144銘柄	100.0%	78.3%
カナダドル	投資証券　30銘柄	100.0%	1.7%
ユーロ	投資証券　28銘柄	100.0%	3.5%
イギリスポンド	投資証券　38銘柄	100.0%	4.5%
オーストラリアドル	投資証券　31銘柄	100.0%	6.4%
ニュージーランドドル	投資証券　6銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券　6銘柄	100.0%	1.3%
シンガポールドル	投資証券　25銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券　13銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券　3銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	106,898,356
コール・ローン	165,285,674
社債券	23,537,359,374
流動資産合計	23,809,543,404
資産合計	23,809,543,404
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,149,852
未払利息	137
流動負債合計	7,149,989

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
負債合計	7,149,989
純資産の部	
元本等	
元本	41,280,085,914
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△17,477,692,499
元本等合計	23,802,393,415
純資産合計	23,802,393,415
負債純資産合計	23,809,543,404

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10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
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10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		41,280,085,914口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	17,477,692,499円

	2023年 7月10日現在	
3． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	0.5766円
	(1万口当たり純資産額)	(5,766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 7月10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 7月10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。

	2023年 7月10日現在

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	41,303,886,285円
期中追加設定元本額	7,348,734,289円
期中一部解約元本額	7,372,534,660円
期末元本額	41,280,085,914円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（ＳＭＡ専用）	30,033,975,240円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,496,803,456円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,287,447,959円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,030,204,672円
ＳＭＴＡＭコモディティ・オープン	3,698,816,826円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	555,425,246円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	135,882,550円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	1,495,273,093円
ＦＯＦｓ用　グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	485,994,127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）	60,262,745円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

	2023年 7月10日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	475,541,948
合計	475,541,948

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

（デリバティブ取引に関する注記）

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
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 041 05/31/24	7,000,000.00	6,710,200.00	
		ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000.00	4,288,000.00	
		IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000.00	4,617,000.00	
		SG ISSUER 030 09/29/23	20,000,000.00	17,988,000.00	
		SG ISSUER 031 11/30/23	24,000,000.00	21,741,600.00	
		SG ISSUER 032 01/31/24	19,000,000.00	17,348,900.00	
		SG ISSUER 033 03/28/24	18,000,000.00	16,484,400.00	
		STAR HELIOS 008 10/24/23	49,000,000.00	75,950,000.00	
	アメリカドル 小計		192,000,000.00	165,128,100.00 (23,537,359,374)	
合計				23,537,359,374 (23,537,359,374)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率

アメリカドル	社債券　　8銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,687,630
コール・ローン	112,164,243
投資信託受益証券	30,403,512,556
派生商品評価勘定	386,764,962
流動資産合計	30,905,129,391
資産合計	30,905,129,391
負債の部	
流動負債	
未払金	506,028
未払解約金	9,764,061
未払利息	93
流動負債合計	10,270,182
負債合計	10,270,182
純資産の部	
元本等	
元本	24,854,962,097
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,039,897,112
元本等合計	30,894,859,209
純資産合計	30,894,859,209
負債純資産合計	30,905,129,391

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10日現在
１.有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券

	2023年 7月10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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	24,854,962,097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 1.2430円 (1万口当たり純資産額) (12,430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 7月10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 7月10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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	25,625,430,409円
期中追加設定元本額	5,719,589,312円
期中一部解約元本額	6,490,057,624円
期末元本額	24,854,962,097円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,323,181,016円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,619,980,624円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,034,630,620円
分散投資コア戦略ファンドＳ	7,439,587,857円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,663,978,391円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	517,627,891円
グローバル経済コア	1,310,568,348円
ＳＭＴ　ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,464,735,644円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	912,842,328円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	207,870,061円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	591,073,671円
ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	679,703,398円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	89,182,248円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	2,568,371,330
合計	2,568,371,330

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	30,620,951,155	－	30,234,186,193	386,764,962
	アメリカドル	30,620,951,155	－	30,234,186,193	386,764,962
合計		30,620,951,155	－	30,234,186,193	386,764,962

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	5,850,195	213,298,109.70	
	アメリカドル 小計		5,850,195	213,298,109.70 (30,403,512,556)	
合計			5,850,195	30,403,512,556 (30,403,512,556)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

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

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

米国株式ＬＳマザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,320,676,638
社債券	21,678,539,278
派生商品評価勘定	321,632,000
流動資産合計	23,320,847,916
資産合計	23,320,847,916
負債の部	
流動負債	
未払金	872,933,600
未払解約金	1,117,283
未払利息	1,101
流動負債合計	874,051,984
負債合計	874,051,984
純資産の部	
元本等	
元本	20,689,301,202
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,757,494,730
元本等合計	22,446,795,932
純資産合計	22,446,795,932
負債純資産合計	23,320,847,916

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10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	20,689,301,202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 1.0849円 (1万口当たり純資産額) (10,849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 7月10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 7月10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、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

２．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	20,206,233,087円
期中追加設定元本額	3,934,553,381円
期中一部解約元本額	3,451,485,266円
期末元本額	20,689,301,202円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,462,094,500円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,913,062,233円
コア投資戦略ファンド（切替型）	898,365,040円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	267,116,183円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	14,952,737,882円
米国株式ＬＳファンド（ＳＭＡ専用）	230,209,237円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	399,064,145円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	88,334,461円
ＦＯＦｓ用　米国株式ＬＳファンドＳ（適格機関投資家専用）	478,317,521円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	1,544,339,795
合計	1,544,339,795

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	21,871,052,000	－	21,549,420,000	321,632,000
	アメリカドル	21,871,052,000	－	21,549,420,000	321,632,000
合計		21,871,052,000	－	21,549,420,000	321,632,000

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	STAR HELIOS 004 10/18/27	123,000,000.00	152,087,409.00	
	アメリカドル 小計		123,000,000.00	152,087,409.00 (21,678,539,278)	
合計				21,678,539,278 (21,678,539,278)	

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	社債券　　1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	143,074,333
社債券	20,491,356,000
流動資産合計	20,634,430,333
資産合計	20,634,430,333
負債の部	
流動負債	
未払利息	119
流動負債合計	119
負債合計	119
純資産の部	
元本等	
元本	16,709,667,647
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,924,762,567
元本等合計	20,634,430,214
純資産合計	20,634,430,214
負債純資産合計	20,634,430,333

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10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	16,709,667,647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　1.2349円 (1万口当たり純資産額)　(12,349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 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10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。

	2023年 7月10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。

（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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	20,570,158,540円
期中追加設定元本額	545,528,134円
期中一部解約元本額	4,406,019,027円
期末元本額	16,709,667,647円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,193,173,131円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,545,396,700円
コア投資戦略ファンド（切替型）	732,422,024円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	222,383,629円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	11,950,183,496円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	324,710,324円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	74,724,450円
コモディティＬＳアルファ・ファンド（ＳＭＡ専用）	187,683,162円
ＦＯＦｓ用　コモディティＬＳアルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	478,990,731円

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

	2023年 7月10日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	△434,628,000
合計	△434,628,000

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	ソシエテ・ジェネラル　０％　２０２４／０５／３１	300,000,000	297,990,000	
	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　０７／１６／２４	16,230,000,000	20,193,366,000	
合計		16,530,000,000	20,491,356,000	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	39,391,212
社債券	8,719,330,000

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	8,758,721,212
資産合計	8,758,721,212
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,299,638
未払利息	32
流動負債合計	1,299,670
負債合計	1,299,670
純資産の部	
元本等	
元本	9,732,934,872
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△975,513,330
元本等合計	8,757,421,542
純資産合計	8,757,421,542
負債純資産合計	8,758,721,212

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10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 7月10日現在
1． 計算期間の末日における受益権の総数		9,732,934,872口
2． 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	975,513,330円
3． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額	0.8998円
	(1万口当たり純資産額)	(8,998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 7月10日現在
1 .金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 .金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3 .金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	10,531,261,653円
期中追加設定元本額	857,453,514円
期中一部解約元本額	1,655,780,295円
期末元本額	9,732,934,872円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	591,407,510円
コア投資戦略ファンド（成長型）	753,477,327円
コア投資戦略ファンド（切替型）	362,956,380円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	154,896,295円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	6,745,366,965円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	162,972,915円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	35,469,763円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（ＳＭＡ専用）	153,773,205円
ＦＯＦｓ用　米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	204,928,907円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	567,685,605円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	△1,605,900
合計	△1,605,900

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　１０／１８／２３	9,700,000,000	8,719,330,000	
合計		9,700,000,000	8,719,330,000	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,855,978,968
国債証券	11,831,192,840
派生商品評価勘定	227,539,490
未収入金	66,959,673
差入委託証拠金	2,369,173,621
流動資産合計	21,350,844,592
資産合計	21,350,844,592
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,036,605
前受金	198,472,959
未払金	113,295,876
未払解約金	1,001,489
未払利息	5,715
流動負債合計	360,812,644
負債合計	360,812,644
純資産の部	
元本等	
元本	18,037,415,789
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,952,616,159
元本等合計	20,990,031,948

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
純資産合計	20,990,031,948
負債純資産合計	21,350,844,592

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10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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(外貨建先物取引は、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10日現在	
1． 計算期間の末日における受益権の総数		18,037,415,789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	1.1637円
	(1万口当たり純資産額)	(11,637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 7月10日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引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 7月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2023年 7月10日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	252,120,355円
期中追加設定元本額	17,817,943,970円
期中一部解約元本額	32,648,536円
期末元本額	18,037,415,789円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	475,146,861円
コア投資戦略ファンド（成長型）	617,507,446円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,121,663,480円
分散投資コア戦略ファンドＳ	6,009,060,337円
コア投資戦略ファンド（切替型）	288,321,085円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	117,442,367円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	8,031,435,641円

区分	2023年 7月10日現在
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	128,875,338円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	28,048,620円
ＳＭＴＡＭ・ＦＯＦｓ用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド（４％目標コース）（適格機関投資家専用）	219,471,819円
ＦＯＦｓ用　ＧＢＣＡファンドＳ（ミドルリスク型）（適格機関投資家専用）	442,795円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△3,821,060
合計	△3,821,060

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）」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 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	4,737,490,000	－	4,721,600,000	△15,890,000
	売建	9,880,882,080	－	9,666,519,121	214,362,959
合計		14,618,372,080	－	14,388,119,121	198,472,959

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、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.外貨建先物取引は、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10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	2,357,935,679	－	2,351,059,683	△6,875,996
	アメリカドル	1,138,891,090	－	1,132,242,465	△6,648,625
	カナダドル	594,329,958	－	590,763,292	△3,566,666
	スウェーデンクローナ	526,346,380	－	529,685,365	3,338,985
	オーストラリアドル	98,368,251	－	98,368,561	310
	売建	4,085,855,668	－	4,097,939,186	△12,083,518
	ユーロ	811,721,586	－	810,159,358	1,562,228
	イギリスポンド	692,775,469	－	693,493,362	△717,893
	スイスフラン	2,357,368,636	－	2,370,352,371	△12,983,735
	ノルウェークローネ	121,506,529	－	121,451,111	55,418
	ニュージーランドドル	102,483,448	－	102,482,984	464
合計		6,443,791,347	－	6,448,998,869	△18,959,514

(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	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第１１０８回国庫短期証券	1,000,000,000	1,000,249,000	
	第１１１５回国庫短期証券	2,120,000,000	2,120,937,040	
	第１１４５回国庫短期証券	1,700,000,000	1,701,774,800	
	第１１５２回国庫短期証券	7,000,000,000	7,008,232,000	
合計		11,820,000,000	11,831,192,840	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）】

【純資産額計算書】

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	18,015,997,075円
Ⅱ　負債総額	52,965,559円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	17,963,031,516円
Ⅳ　発行済口数	14,305,432,949口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2557円
（1万口当たり純資産額）	（12,557円）

（参考）

国内株式インデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	572,150,231,744円
Ⅱ　負債総額	843,828,988円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	571,306,402,756円
Ⅳ　発行済口数	242,074,960,021口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3600円
（1万口当たり純資産額）	（23,600円）

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	11,733,285,009円
Ⅱ　負債総額	2,739,233円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	11,730,545,776円
Ⅳ　発行済口数	9,218,219,696口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2725円
（1万口当たり純資産額）	（12,725円）

日本債券ツイン戦略マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	75,862,388,154円
Ⅱ　負債総額	9,067,842,808円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	66,794,545,346円
Ⅳ　発行済口数	70,814,611,034口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9432円
（1万口当たり純資産額）	（9,432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 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	588,839,251,271円
Ⅱ　負債総額	557,759,992円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	588,281,491,279円
Ⅳ　発行済口数	113,408,544,064口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.1873円
（1万口当たり純資産額）	（51,873円）

外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	11,641,537,688円
Ⅱ　負債総額	14,663,778円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	11,626,873,910円
Ⅳ　発行済口数	8,544,131,925口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3608円
（1万口当たり純資産額）	（13,608円）

世界債券総合インデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	46,514,641,846円
Ⅱ　負債総額	58,277,433円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	46,456,364,413円
Ⅳ　発行済口数	44,345,615,336口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0476円
（1万口当たり純資産額）	（10,476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 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	160,894,834,304円
Ⅱ　負債総額	278,770,015円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	160,616,064,289円
Ⅳ　発行済口数	40,423,626,846口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.9733円
（1万口当たり純資産額）	（39,733円）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	142,482,062,849円
Ⅱ　負債総額	1,806,566,058円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	140,675,496,791円
Ⅳ　発行済口数	65,884,761,439口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1352円
（1万口当たり純資産額）	（21,352円）

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	92,852,819,208円
Ⅱ　負債総額	72,854,056円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	92,779,965,152円

Ⅳ　発行済口数	35,813,746,255口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5906円
（1万口当たり純資産額）	（25,906円）

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	25,320,455,177円
Ⅱ　負債総額	139,100,025円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	25,181,355,152円
Ⅳ　発行済口数	42,052,842,983口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.5988円
（1万口当たり純資産額）	（5,988円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	32,334,555,204円
Ⅱ　負債総額	402,933,665円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	31,931,621,539円
Ⅳ　発行済口数	25,337,241,307口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2603円
（1万口当たり純資産額）	（12,603円）

米国株式ＬＳマザーファンド

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	22,611,764,322円
Ⅱ　負債総額	867円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,611,763,455円
Ⅳ　発行済口数	20,679,598,012口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0934円
（1万口当たり純資産額）	（10,934円）

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	21,198,653,001円
Ⅱ　負債総額	480,662円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,198,172,339円
Ⅳ　発行済口数	17,310,080,674口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2246円
（1万口当たり純資産額）	（12,246円）

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	9,162,345,387円
Ⅱ　負債総額	50,168円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,162,295,219円
Ⅳ　発行済口数	10,210,225,536口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8974円
（1万口当たり純資産額）	（8,974円）

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

純資産額計算書

（2023年 7月31日現在）

Ⅰ　資産総額	21,598,552,468円
Ⅱ　負債総額	145,726,399円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,452,826,069円
Ⅳ　発行済口数	18,643,938,716口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1507円
（1万口当たり純資産額）	（11,507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。

第二部【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 7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10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7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	527	14,660,791
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	66	203,542
単位型公社債投資信託	51	170,108
合計	644	15,034,440

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10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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2022年10月11日	有価証券届出書
2022年10月11日	有価証券報告書
2023年 4月11日	有価証券届出書
2023年 4月11日	半期報告書

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9月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　後藤知弘

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2022年7月12日から2023年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）の2023年7月10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。