# 【表紙】

| | |
|---|---|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2023年10月10日提出 |
| 【発行者名】 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 菱田　賀夫 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区芝公園一丁目１番１号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 上坪　直樹 |
| 【電話番号】 | 03-6453-3610 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 | コア投資戦略ファンド（切替型） |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】 | 10兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

**第一部【証券情報】**

**（1）【ファンドの名称】**

**コア投資戦略ファンド（切替型）**
**愛称として、「コアラップ（切替型）」という名称を用いることがあります。**

**（2）【内国投資信託受益証券の形態等】**

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

**（3）【発行（売出）価額の総額】**

**10兆円を上限とします。**

**（4）【発行（売出）価格】**

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

**（5）【申込手数料】**

**取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.3%（税抜　3.0%）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。**
**申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。**
**※「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。**

**（6）【申込単位】**

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

れるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

（７）【申込期間】

2023年10月11日から2024年 4月10日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎての

**お申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。**

**＜申込みコース＞**

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

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

**＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞**

**収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第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。**

**＜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。**

**＜受付不可日＞に該当する場合は、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。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。**

**＜受付不可日＞**

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

**ニューヨーク証券取引所の休業日**

**ロンドン証券取引所の休業日**

**ニューヨークの銀行休業日**

**ロンドンの銀行休業日**

# 第二部【ファンド情報】

## 第１【ファンドの状況】

### １【ファンドの性格】

#### （１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　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<br>（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<br>（　　） | | |
| | | **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<br>地域 | 投資形態 | 為替<br>ヘッジ | 対象<br>インデックス | 特殊型 |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 株式<br>一般<br>大型株<br>中小型株<br><br>債券<br>一般<br>公債<br>社債<br>その他債券<br>クレジット属性<br>（　　）<br><br>不動産投信<br><br>その他資産<br>（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））<br><br>資産複合<br>（　　）<br>資産配分固定型<br>資産配分変更型 | 年1回<br><br>年2回<br><br>年4回<br><br>年6回（隔月）<br><br>年12回（毎月）<br><br>日々<br><br>その他（　） | グローバル（日本を含む）<br><br>日本<br><br>北米<br><br>欧州<br><br>アジア<br><br>オセアニア<br><br>中南米<br><br>アフリカ<br><br>中近東（中東）<br><br>エマージング | ファミリーファンド<br><br>ファンド・オブ・ファンズ | あり（部分ヘッジ）<br><br>なし | 日経225<br><br>ＴＯＰＩＸ<br><br>その他（　　） | ブル・ベア型<br><br>条件付運用型<br><br>ロング・ショート型/絶対収益追求型<br><br>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、75%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。**

## ポートフォリオ構築プロセス

●運用に当たっては三井住友信託銀行から投資助言を受けます。

**投資割合の決定・見直し（年1回）**

- STEP1 各資産の中長期的な期待リターン、リスク（標準偏差）、相関係数（各資産間の値動きの関係性を示す係数）を推定
- STEP2 資産間の分散を徹底するため、資産毎の投資割合の制約条件（上限値または下限値）を設定
- STEP3 資産毎の期待リターン・リスク・相関係数や制約条件をもとに、中長期的な見通しから「安定型ポートフォリオ」「成長型ポートフォリオ」を決定
- STEP4 【切替機能(*)】2つのポートフォリオの範囲内で、短期的な市場動向等に応じて、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合を調整

**投資対象ファンドの決定・見直し（随時）**

- STEP1 各資産の投資対象ファンドの特徴や運用パフォーマンス等を分析
- STEP2 ポートフォリオのリターン向上及びリスク低減を目的として、投資対象ファンドの組入れや入替え効果を検証
- STEP3 投資対象ファンドの組入れ・入替え効果の検証結果に基づき、ファンドの組入れ・入替えや投資割合を決定

※市場環境の急激な変化に応じて、リスク低減等を目的として、各資産や投資対象ファンドの投資割合の見直しを行うことがあります。

**定期的なリバランスの実施（年4回）**

相対的に値上がりした資産の売却や値下がりした資産の購入を行うことなどにより、最適な投資割合からの乖離を修正

※市場環境等によっては、定期的なリバランスを行わない場合があります。また、臨時に行うこともあります。

※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）」の切替機能のイメージ>

短期的な市場環境等の変化に対応して、リスク水準の異なる2つのポートフォリオの範囲内で、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合を機動的に調整します。

**安定型ポートフォリオ**
債券や下値抵抗力が期待できるヘッジファンドの組入比率が高く、安定性を重視したポートフォリオ

市場環境等の変化に対応して、リスク水準の異なる2つのポートフォリオの範囲内で投資割合を調整

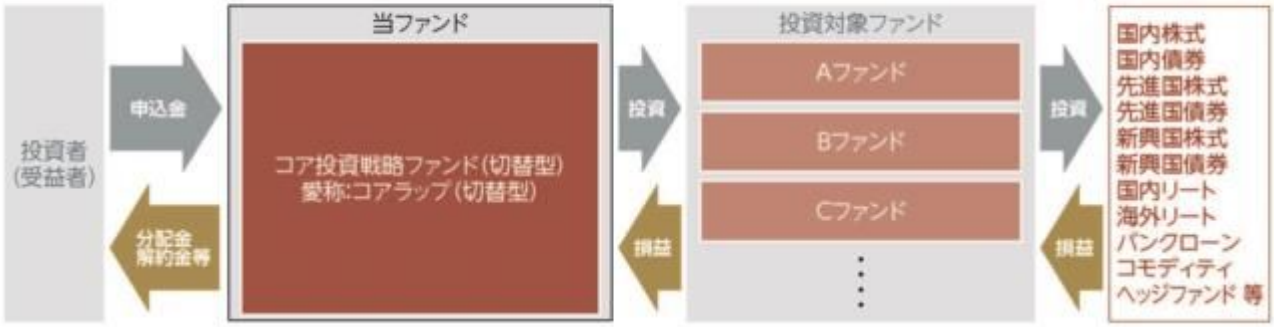
**成長型ポートフォリオ**
債券や高い収益が期待できる株式・新興国の資産などをバランスよく組み入れ、安定性と収益性のバランスを重視したポートフォリオ

**コアラップ（切替型）**
市場環境の変化を捉えた機動的な運用を行います。

※各ポートフォリオは適宜見直しを行います。

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。

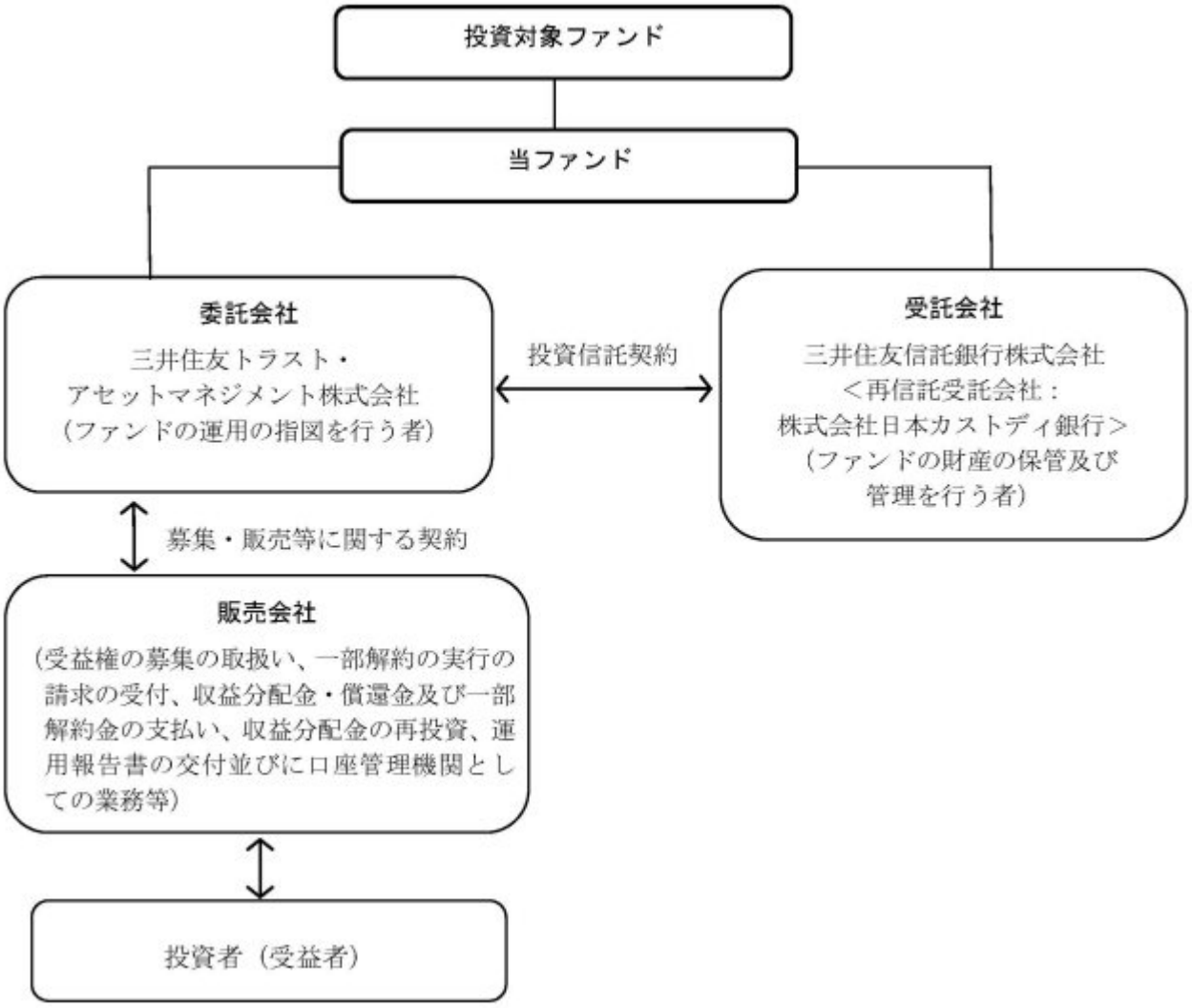
**資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。**

**（２）【ファンドの沿革】**

**2013年10月17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、75%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。**<br>**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。**<br>**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。**<br>**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。**<br>**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。<br>②外貨建資産への投資は、行いません。<br>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。<br>④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。**<br>**②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。**<br>**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。**<br>**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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資は行いません。<br>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。<br>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。**<br>**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。**<br>**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。**<br>**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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資は行ないません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。）。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>・日本の株式を主要投資対象とします。<br>・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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資は、行いません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>③公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資は行いません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>②外貨建資産への投資は行いません。<br>③有価証券先物取引等の直接利用は行いません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>新発10年固定利付国債の利回り　　信託報酬<br>0.5%未満の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.264%<br>（税抜　0.24%）<br>0.5%以上１%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.297%<br>（税抜　0.27%）<br>１%以上の場合 ・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.33%<br>（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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>⑥公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>⑦外貨建資産への投資は行いません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>＜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＞<br>わが国の公社債を主要投資対象とします。<br>＜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＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>＜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＞<br>①NOMURA-BPI（総合）指数をベンチマークとします。<br>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。<br>③公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。<br>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。<br>＜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＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>⑤外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>・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。<br>・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。<br>・純資産総額100億円以下の部分　年率0.275%（税抜　0.25%）<br>・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。<br>・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。<br>・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。<br>・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。<br>・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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資は行いません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>新発10年固定利付国債の利回り　　信託報酬<br>2%未満の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.2035%（税抜　0.185%）<br>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%）<br>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%）<br>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%）<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。<br>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。<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>②外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>⑦デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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%）<br>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。<br>＜マザーファンドの投資対象＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>＜マザーファンドの投資態度＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>※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%）<br>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。<br>＜マザーファンドの投資対象＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>＜マザーファンドの投資態度＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>・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。<br>・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。<br>＜マザーファンドの投資対象＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>＜マザーファンドの投資態度＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>・純資産総額100億円以下の部分<br>年率0.704%（税抜　0.64%）<br>・純資産総額100億円超、200億円以下の部分<br>年率0.649%（税抜　0.59%）<br>・純資産総額200億円超の部分<br>年率0.594%（税抜　0.54%）<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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%<br>その他の費用<br>ファンド管理費用：上限年率0.15%<br>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<br>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<br>・投資顧問会社<br>キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー<br>・管理事務代行会社<br>J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店）<br>・名義書換事務受託会社<br>J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店）<br>・保管受託銀行<br>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。<br>②債券等への投資割合は、原則として高位を維持します。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>＜マザーファンドの投資対象＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>＜マザーファンドの投資態度＞<br>①主に、日本を除く世界の公社債に投資します。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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）<br>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）<br>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）<br>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）<br>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）<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>＊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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>④外貨建資産への投資は行いません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br><br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>＜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）<br>iShares Gold Trust<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>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。<br>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）<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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%<br>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<br>BlueBay Funds Management Company S.A.<br>・投資顧問会社<br>RBC Global Asset Management (UK) Limited<br>・副投資顧問会社<br>RBC Global Asset Management (U.S.) Inc.<br>・管理事務代行会社／名義書換事務受託会社／保管受託銀行<br>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。<br>※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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資は行いません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>※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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>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。<br>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。<br>※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。<br>※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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資は行いません。<br>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。<br>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。<br>※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。<br>※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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資は行いません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>④デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。<br>⑤為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>＜日本成長株投資マザーファンドの投資態度＞<br>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。<br>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。<br>③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。<br>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。<br>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。<br>＜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＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>④デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>＜マザーファンドの投資対象＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>＜マザーファンドの投資態度＞<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>⑤外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。<br>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。<br>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％）<br>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。<br>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。<br>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。<br>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。<br>②投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。<br>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。<br>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。<br>⑤外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>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。<br>⑦投資信託証券への投資は行いません。<br>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%<br>成功報酬：15%<br>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<br>UBS O'Connor LLC<br>・保管銀行・管理事務代行会社<br>MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited |

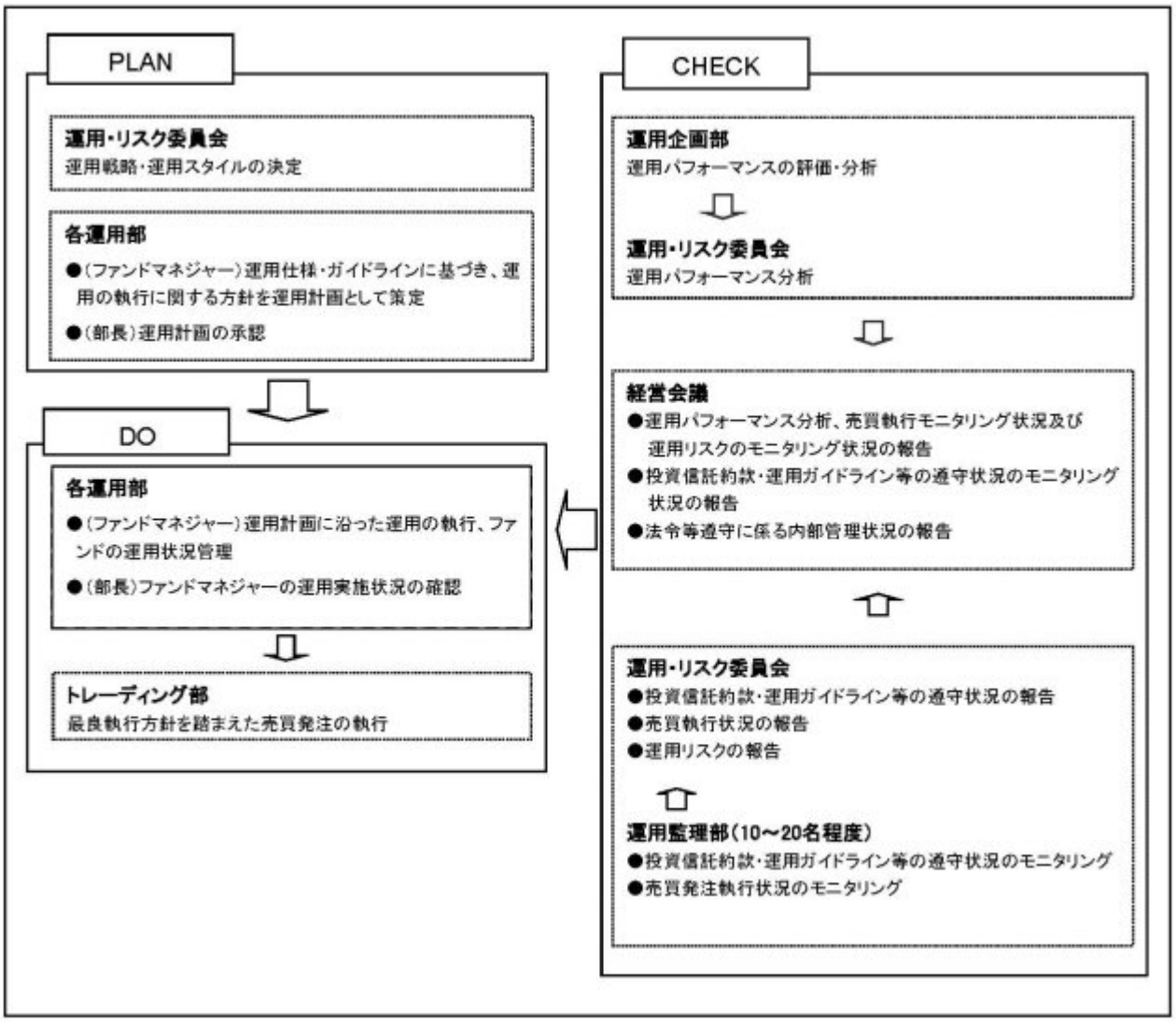
36.MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR

| | |
|---|---|
| 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。<br>・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。<br>・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。<br>・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。<br>・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。<br>・現物の空売りは行いません。<br>・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。<br>・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%<br>成功報酬：12%<br>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）<br>SG Kleinwort Hambros Corporate Services (CI) Limited<br>・投資顧問会社（トレーディング・アドバイザー）<br>Graham Capital Management, L.P.<br>・副管理会社（サブ・マネージャー）<br>Amundi Asset Management S.A.S<br>・管理事務代行会社（アドミニストレーター）<br>Societe Generale Securities Services France S.A.<br>・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント）<br>CACEIS Investor Services Bank S.A.<br>・保管受託銀行（カストディ）<br>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。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

（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。**

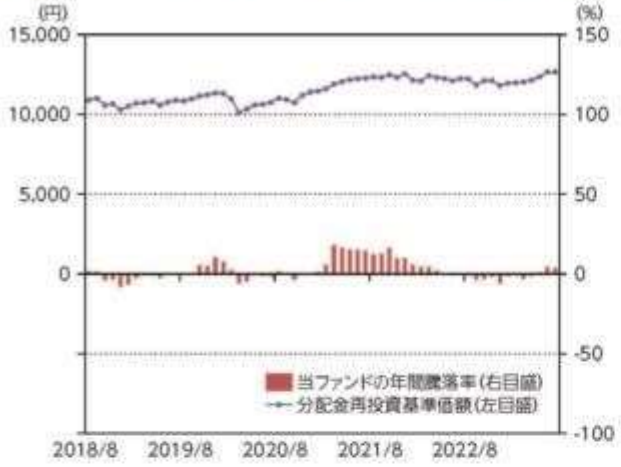
**(2)リスクの管理体制**

**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

＊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、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

### 各資産クラスの指数について

| | |
|---|---|
| 日本株<br>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、指数値の算出、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場害に対してもJPXは責任を負いません。 |
| 先進国株<br>MSCIコクサイ・インデックス<br>(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<br>MSCIエマージング・マーケット・<br>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<br>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<br>FTSE世界国債インデックス<br>(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<br>JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース) | 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・操作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。<br>新発10年固定利付国債の利回り　信託報酬<br>0.5%未満の場合・・・・・・・・・・年率　0.264%（税抜　0.24%）<br>0.5%以上１%未満の場合・・・・・年率　0.297%（税抜　0.27%）<br>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<br>年率0.275%（税抜　0.25%）<br>・純資産総額100億円超の部分<br>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。<br>新発10年固定利付国債の利回り　信託報酬<br>2%未満の場合・・・・・・・・年率0.2035%<br>（税抜　0.185%）<br>2%以上3%未満の場合・・・・年率0.2475%<br>（税抜　0.225%）<br>3%以上4%未満の場合・・・・年率0.2915%<br>（税抜　0.265%）<br>4%以上5%未満の場合・・・・年率0.3355%<br>（税抜　0.305%）<br>5%以上の場合・・・・・・・・年率0.3795%<br>（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<br>年率0.704%（税抜　0.64%）<br>・純資産総額100億円超、200億円以下の部分<br>年率0.649%（税抜　0.59%）<br>・純資産総額200億円超の部分<br>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%<br>成功報酬：15%<br>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%<br>成功報酬：12%<br>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）】

（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 | 12,081,899,452 | 37.04 |
| 投資証券 | ルクセンブルク | 1,373,143,647 | 4.21 |
| | ケイマン | 633,566,079 | 1.94 |
| | ジャージー | 307,495,604 | 0.94 |
| | 小計 | 2,314,205,330 | 7.10 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 16,288,591,294 | 49.94 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | 1,930,123,000 | 5.92 |
| 合計(純資産総額) | | 32,614,819,076 | 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 | 1,322,566,262 | 2.2797 | 3,015,123,271 | 2.3600 | 3,121,256,378 | 9.57 |
| 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 | 1,065,600,194 | 2.1030 | 2,240,981,859 | 2.1352 | 2,275,269,534 | 6.98 |
| 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） | 1,758,421,008 | 1.2444 | 2,188,325,140 | 1.2603 | 2,216,137,996 | 6.79 |
| 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 | 1,503,268,832 | 1.0442 | 1,569,713,314 | 1.0476 | 1,574,824,428 | 4.83 |
| 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 | 510,318,247 | 2.5486 | 1,300,597,084 | 2.5906 | 1,322,030,450 | 4.05 |
| 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） | 1,342,035,309 | 0.967 | 1,297,782,916 | 0.9617 | 1,290,635,356 | 3.96 |
| 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） | 1,134,967,489 | 0.9651 | 1,095,367,698 | 0.9572 | 1,086,390,880 | 3.33 |
| 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 | 1,147,189,804 | 0.9512 | 1,091,248,951 | 0.9432 | 1,082,029,423 | 3.32 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 米国株式ＬＳマザーファンド | 898,365,040 | 1.0849 | 974,636,231 | 1.0934 | 982,272,334 | 3.01 |
| 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 | 732,422,024 | 1.2349 | 904,467,957 | 1.2246 | 896,924,010 | 2.75 |
| 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） | 989,775,658 | 0.8866 | 877,535,098 | 0.8852 | 876,149,412 | 2.69 |
| 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） | 614,186,639 | 1.3478 | 827,800,752 | 1.3785 | 846,656,281 | 2.60 |
| 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） | 324,865,042 | 2.5035 | 813,299,632 | 2.5786 | 837,696,997 | 2.57 |
| 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） | 612,480,834 | 1.2811 | 784,649,196 | 1.2698 | 777,728,163 | 2.38 |
| 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） | 720,837,921 | 1.0897 | 785,497,082 | 1.0722 | 772,882,418 | 2.37 |
| 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） | 754,106,996 | 1.0199 | 769,113,725 | 1.0174 | 767,228,457 | 2.35 |
| 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） | 534,621,058 | 1.2713 | 679,663,751 | 1.3092 | 699,925,889 | 2.15 |
| ルクセンブルク | 投資証券 | Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL | 372,100.371 | 1,800 | 669,780,667 | 1,875 | 697,688,195 | 2.14 |
| 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 | 133,649,708 | 5.0155 | 670,332,010 | 5.1873 | 693,281,130 | 2.13 |
| 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） | 490,990,004 | 1.383 | 679,039,175 | 1.3912 | 683,065,293 | 2.09 |
| ルクセンブルク | 投資証券 | BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY | 62,613.017 | 10,637.07 | 666,019,149 | 10,787.78 | 675,455,452 | 2.07 |
| 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） | 350,828,265 | 1.9379 | 679,870,094 | 1.925 | 675,344,410 | 2.07 |
| 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） | 583,770,397 | 1.1591 | 676,648,267 | 1.1477 | 669,993,284 | 2.05 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 1,105,401,422 | 0.5775 | 638,456,013 | 0.5988 | 661,914,371 | 2.03 |
| ケイマン | 投資証券 | MA Hedge Fund Strategies Limited | 64,400 | 9,826.56 | 632,830,464 | 9,837.98 | 633,566,079 | 1.94 |
| 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） | 705,800,613 | 0.8952 | 631,832,708 | 0.888 | 626,750,944 | 1.92 |
| 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） | 415,800,427 | 1.441 | 599,168,415 | 1.472 | 612,058,228 | 1.88 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | 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） | 428,618,207 | 1.0106 | 433,192,543 | 1.0043 | 430,461,265 | 1.32 |
| 日本 | 投資信託受益証券 | ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド（適格機関投資家専用） | 429,533,522 | 1.0046 | 431,544,439 | 0.9986 | 428,932,175 | 1.32 |
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド | 375,790,307 | 0.8997 | 338,118,150 | 0.8974 | 337,234,221 | 1.03 |

**(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 | 37.04 |
| 投資証券 | 7.10 |
| 親投資信託受益証券 | 49.94 |
| 合計 | 94.08 |

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

**②【投資不動産物件】**

**該当事項はありません。**

**③【その他投資資産の主要なもの】**

**該当事項はありません。**

**（３）【運用実績】**

**①【純資産の推移】**

| | 純資産総額（円） | | 1万口当たりの純資産額（円） | |
|---|---|---|---|---|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第1期計算期間末　(2014年 7月10日) | 8,047,177,409 | 8,047,177,409 | 10,389 | 10,389 |
| 第2期計算期間末　(2015年 7月10日) | 27,366,014,831 | 27,366,014,831 | 10,787 | 10,787 |
| 第3期計算期間末　(2016年 7月11日) | 30,311,407,780 | 30,311,407,780 | 10,121 | 10,121 |
| 第4期計算期間末　(2017年 7月10日) | 27,946,158,080 | 27,946,158,080 | 10,720 | 10,720 |
| 第5期計算期間末　(2018年 7月10日) | 31,588,404,244 | 31,588,404,244 | 10,895 | 10,895 |
| 第6期計算期間末　(2019年 7月10日) | 31,612,123,675 | 31,612,123,675 | 10,862 | 10,862 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 第7期計算期間末 | (2020年 7月10日) | 28,489,916,074 | 28,489,916,074 | 10,680 | 10,680 |
| 第8期計算期間末 | (2021年 7月12日) | 29,305,810,861 | 29,305,810,861 | 12,276 | 12,276 |
| 第9期計算期間末 | (2022年 7月11日) | 30,094,696,745 | 30,094,696,745 | 12,081 | 12,081 |
| 第10期計算期間末 | (2023年 7月10日) | 32,359,119,133 | 32,359,119,133 | 12,548 | 12,548 |
| | 2022年 7月末日 | 30,743,346,079 | — | 12,239 | — |
| | 8月末日 | 31,056,393,273 | — | 12,223 | — |
| | 9月末日 | 30,357,794,897 | — | 11,847 | — |
| | 10月末日 | 31,105,043,782 | — | 12,110 | — |
| | 11月末日 | 31,007,204,267 | — | 12,116 | — |
| | 12月末日 | 30,289,315,949 | — | 11,810 | — |
| | 2023年 1月末日 | 30,811,443,138 | — | 11,955 | — |
| | 2月末日 | 30,900,705,998 | — | 11,982 | — |
| | 3月末日 | 31,065,911,684 | — | 12,032 | — |
| | 4月末日 | 31,411,002,854 | — | 12,144 | — |
| | 5月末日 | 31,879,880,032 | — | 12,343 | — |
| | 6月末日 | 32,607,235,132 | — | 12,646 | — |
| | 7月末日 | 32,614,819,076 | — | 12,660 | — |

②【分配の推移】

| | 期　間 | 1万口当たりの分配金（円） |
|---|---|---|
| 第1期計算期間 | 2013年10月17日～2014年 7月10日 | 0 |
| 第2期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 0 |
| 第3期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | 0 |
| 第4期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 0 |
| 第5期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 0 |
| 第6期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | 0 |
| 第7期計算期間 | 2019年 7月11日～2020年 7月10日 | 0 |
| 第8期計算期間 | 2020年 7月11日～2021年 7月12日 | 0 |
| 第9期計算期間 | 2021年 7月13日～2022年 7月11日 | 0 |
| 第10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 | 2013年10月17日～2014年 7月10日 | 3.9 |
| 第2期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 3.8 |
| 第3期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | △6.2 |
| 第4期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 5.9 |
| 第5期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 1.6 |
| 第6期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | △0.3 |

| | | |
|---|---|---|
| 第7期計算期間 | 2019年 7月11日～2020年 7月10日 | △1.7 |
| 第8期計算期間 | 2020年 7月11日～2021年 7月12日 | 14.9 |
| 第9期計算期間 | 2021年 7月13日～2022年 7月11日 | △1.6 |
| 第10期計算期間 | 2022年 7月12日～2023年 7月10日 | 3.9 |

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## （４）【設定及び解約の実績】

| | 期　間 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 発行済み口数（口） |
|---|---|---|---|---|
| 第1期計算期間 | 2013年10月17日～2014年 7月10日 | 7,756,133,400 | 10,141,270 | 7,745,992,130 |
| 第2期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 17,904,927,940 | 280,776,696 | 25,370,143,374 |
| 第3期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | 5,892,656,977 | 1,314,548,833 | 29,948,251,518 |
| 第4期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 1,610,441,134 | 5,489,774,092 | 26,068,918,560 |
| 第5期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 10,500,659,721 | 7,576,138,726 | 28,993,439,555 |
| 第6期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | 7,219,577,787 | 7,109,737,294 | 29,103,280,048 |
| 第7期計算期間 | 2019年 7月11日～2020年 7月10日 | 4,135,234,340 | 6,562,751,288 | 26,675,763,100 |
| 第8期計算期間 | 2020年 7月11日～2021年 7月12日 | 2,229,880,533 | 5,033,545,480 | 23,872,098,153 |
| 第9期計算期間 | 2021年 7月13日～2022年 7月11日 | 3,902,131,262 | 2,862,618,517 | 24,911,610,898 |
| 第10期計算期間 | 2022年 7月12日～2023年 7月10日 | 2,976,027,979 | 2,099,867,593 | 25,787,771,284 |

(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。

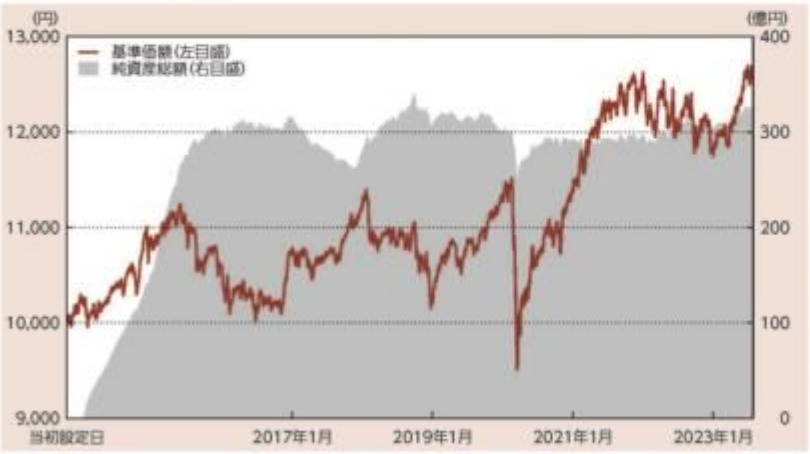
≪参考情報≫

## 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：2013年10月17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 | 12,660円 |
| 純資産総額 | 326.15億円 |

#### 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 | 9.6% |
| J-REIT インデックス マザーファンド | 7.0% |
| ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり) | 6.8% |
| 世界債券総合インデックスマザーファンド | 4.8% |
| グローバルREITインデックス マザーファンド | 4.1% |
| 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) | 4.0% |
| 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) | 3.3% |
| 日本債券ツイン戦略マザーファンド | 3.3% |
| 米国株式LSマザーファンド | 3.0% |
| コモディティLSアルファ・マザーファンド | 2.8% |

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

#### 年間収益率の推移(暦年ベース)

※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。（2013年10月17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2013年10月17日から2014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10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）】

### （１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第9期<br>（2022年 7月11日現在） | 第10期<br>（2023年 7月10日現在） |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,022,183,517 | 1,790,116,865 |
| 投資信託受益証券 | 10,247,798,655 | 11,912,005,491 |
| 投資証券 | 1,317,516,834 | 2,250,198,889 |
| 親投資信託受益証券 | 17,722,920,810 | 15,663,326,835 |
| 未収入金 | 35,000,000 | 1,195,890,000 |
| 流動資産合計 | 30,345,419,816 | 32,811,538,080 |
| 資産合計 | 30,345,419,816 | 32,811,538,080 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | - | 181,474,902 |
| 未払解約金 | 28,820,332 | 35,167,899 |
| 未払受託者報酬 | 8,010,956 | 8,512,943 |
| 未払委託者報酬 | 213,091,310 | 226,444,378 |
| 未払利息 | 312 | 1,492 |
| その他未払費用 | 800,161 | 817,333 |
| 流動負債合計 | 250,723,071 | 452,418,947 |
| 負債合計 | 250,723,071 | 452,418,947 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 24,911,610,898 | 25,787,771,284 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 5,183,085,847 | 6,571,347,849 |
| （分配準備積立金） | 3,006,913,561 | 3,508,965,941 |
| 元本等合計 | 30,094,696,745 | 32,359,119,133 |
| 純資産合計 | 30,094,696,745 | 32,359,119,133 |
| 負債純資産合計 | 30,345,419,816 | 32,811,538,080 |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第9期<br>自　2021年 7月13日<br>至　2022年 7月11日 | 第10期<br>自　2022年 7月12日<br>至　2023年 7月10日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取配当金 | 4,872,415 | 9,564,019 |
| 受取利息 | 5,697 | 4,500 |
| 有価証券売買等損益 | △28,450,550 | 1,671,149,222 |
| その他収益 | - | 668,045 |
| 営業収益合計 | △23,572,438 | 1,681,385,786 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 356,998 | 876,890 |
| 受託者報酬 | 16,153,253 | 17,056,392 |
| 委託者報酬 | 429,676,424 | 453,699,962 |
| その他費用 | 1,614,329 | 1,651,238 |
| 営業費用合計 | 447,801,004 | 473,284,482 |
| 営業利益又は営業損失（△） | △471,373,442 | 1,208,101,304 |
| 経常利益又は経常損失（△） | △471,373,442 | 1,208,101,304 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | △471,373,442 | 1,208,101,304 |
| 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（△） | 16,873,939 | 20,038,987 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 5,433,712,708 | 5,183,085,847 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 890,163,962 | 637,570,293 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 890,163,962 | 637,570,293 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 652,543,442 | 437,370,608 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 652,543,442 | 437,370,608 |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 5,183,085,847 | 6,571,347,849 |

**（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<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(3)親投資信託受益証券<br>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<br>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<br>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10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9期<br>(2022年 7月11日現在) | 第10期<br>(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 | 24,911,610,898口 | 25,787,771,284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 1.2081円<br>(1万口当たり純資産額) (12,081円) | 1口当たり純資産額 1.2548円<br>(1万口当たり純資産額) (12,548円) |

**（損益及び剰余金計算書に関する注記）**

| 第9期<br>自 2021年 7月13日<br>至 2022年 7月11日 | 第10期<br>自 2022年 7月12日<br>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 | 2,176,172,286円 |
| 分配準備積立金額 | D | 3,006,913,561円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 5,183,085,847円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 24,911,610,898口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 2,080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 | 239,654,581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 | 498,496,931円 |
| 収益調整金額 | C | 3,062,381,908円 |
| 分配準備積立金額 | D | 2,770,814,429円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 6,571,347,849円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 25,787,771,284口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 2,548円 |
| 1万口当たり分配金額 | H | －円 |
| 収益分配金金額 | I=F×H/10,000 | －円 |

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

| | 第10期<br>自 2022年 7月12日<br>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。<br>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。 |

２．金融商品の時価等に関する事項

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

（関連当事者との取引に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|---|
| 該当事項はありません。 |

（その他の注記）
元本の移動

| 区分 | 第9期<br>自 2021年 7月13日<br>至 2022年 7月11日 | 第10期<br>自 2022年 7月12日<br>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 | 23,872,098,153円 | 24,911,610,898円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,902,131,262円 | 2,976,027,979円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,862,618,517円 | 2,099,867,593円 |

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

| 種類 | 第9期<br>(2022年 7月11日現在) | 第10期<br>(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 | △146,904,221 | 543,916,497 |
| 投資証券 | △70,322,882 | 57,048,107 |
| 親投資信託受益証券 | 216,226,628 | 898,254,016 |
| 合計 | △1,000,475 | 1,499,218,620 |

**（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） | 989,775,658 | 877,535,098 | |
| | 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） | 415,800,427 | 599,168,415 | |
| | 世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け） | 583,770,397 | 676,648,267 | |
| | 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） | 1,103,779,215 | 1,065,367,698 | |
| | 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） | 490,990,004 | 679,039,175 | |
| | 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） | 398,924,056 | 403,192,543 | |
| | 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） | 350,828,265 | 679,870,094 | |
| | 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） | 720,837,921 | 785,497,082 | |
| | 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用） | 324,865,042 | 813,299,632 | |
| | 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） | 612,480,834 | 784,649,196 | |
| | 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） | 534,621,058 | 679,663,751 | |
| | 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） | 705,800,613 | 631,832,708 | |
| | 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） | 754,106,996 | 769,113,725 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド（適格機関投資家専用） | 399,626,234 | 401,544,439 | |
| | FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用） | 614,186,639 | 827,800,752 | |
| | 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） | 1,279,891,342 | 1,237,782,916 | |
| 投資信託受益証券合計 | | 10,280,284,701 | 11,912,005,491 | |
| 投資証券 | MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR | 29,263 | 306,910,344 | |
| | BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY | 60,262.808 | 640,677,414 | |
| | Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL | 372,100.371 | 669,780,667 | |
| | MA Hedge Fund Strategies Limited | 64,400 | 632,830,464 | |
| 投資証券合計 | | 526,026.179 | 2,250,198,889 | |
| 親投資信託受益証券 | Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド | 1,021,696,978 | 2,146,891,859 | |
| | グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド | 510,318,247 | 1,300,597,084 | |
| | 新興国株式インデックス　マザーファンド | 56,957,230 | 215,264,155 | |
| | 国内株式インデックス　マザーファンド | 1,306,047,151 | 2,976,873,271 | |
| | 外国株式インデックス　マザーファンド | 129,730,185 | 650,052,010 | |
| | グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド | 1,030,204,672 | 594,016,013 | |
| | ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり） | 1,663,978,391 | 2,068,325,140 | |
| | コモディティＬＳアルファ・マザーファンド | 732,422,024 | 904,467,957 | |
| | 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 | 240,510,570 | 295,202,673 | |
| | 外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド | 185,653,993 | 243,930,781 | |
| | 米国株式ＬＳマザーファンド | 898,365,040 | 974,636,231 | |
| | 日本債券ツイン戦略マザーファンド | 1,115,577,580 | 1,061,248,951 | |
| | ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型） | 288,321,085 | 335,519,246 | |
| | 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド | 362,956,380 | 326,588,150 | |
| | 世界債券総合インデックスマザーファンド | 1,503,268,832 | 1,569,713,314 | |
| 親投資信託受益証券合計 | | 11,046,008,358 | 15,663,326,835 | |
| 合計 | | | 29,825,531,215 | |

(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<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(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。<br>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<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>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<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>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<br>(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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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<br>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<br>(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。<br>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。<br><br>(2)投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>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<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>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<br>(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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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<br>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。<br>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<br>債券先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>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。<br><br>(2)債券店頭オプション取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>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<br>(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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(3)投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(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。<br><br>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。<br>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<br>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。<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(3)為替予約取引による為替差損益<br>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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(682,786,094) | |
| 合　計 | | 83,245,041 | | 544,622,314,245<br>(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<br>(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<br>(52,944,664) | |
| 投資信託受益証券合計 | | | 463,076 | 177,859,122<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(232,174,020) | |
| 投資証券合計 | | | 4,008,517 | 11,330,312,536<br>(11,330,312,536) | |
| 合計 | | | | 11,508,171,658<br>(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<br>時価比率 | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>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<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(3)投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>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。<br><br>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。<br>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<br>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。<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(3)為替予約取引による為替差損益<br>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<br>(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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(4,890,778) | |
| 合　計 | | 1,533,193 | | 10,634,189,297<br>(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<br>(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<br>(1,848,861) | |
| 投資信託受益証券合計 | | | 15,705 | 5,872,621<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(2,910,060) | |
| 投資証券合計 | | | 86,018 | 230,324,184<br>(230,324,184) | |
| 合計 | | | | 236,196,805<br>(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<br>時価比率 | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>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<br>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。<br>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。<br><br>(2)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>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。<br><br>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。<br>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<br>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。<br><br>(2)為替予約取引による為替差損益<br>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<br>(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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(2,169,720,458) | |
| 国債証券合計 | | | | 21,342,210,861<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(195,467,302) | |
| 地方債証券合計 | | | | 1,308,195,815<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(2,303,230,641) | |
| **特殊債券合計** | | | | 5,155,295,964<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(53,516,889) | |
| 社債券合計 | | | | 11,019,026,349<br>(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<br>(6,027,483,486) | |
| 投資信託受益証券合計 | | | 461,590 | 6,027,483,486<br>(6,027,483,486) | |
| 合計 | | | | 44,852,212,475<br>(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<br>時価比率 | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>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<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(3)投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>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。<br><br>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。<br>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<br>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。<br>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<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(3)為替予約取引による為替差損益<br>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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(6,379,500,557) | |
| 合　計 | | 1,304,697,261 | | 146,874,045,514<br>(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<br>(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<br>(348,115,979) | |
| 投資信託受益証券合計 | | | 480,960 | 461,615,033<br>(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<br>(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<br>(42,288,879) | |
| 投資証券合計 | | | 870,433 | 123,704,439<br>(123,704,439) | |
| 合計 | | | | 585,319,472<br>(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<br>時価比率 | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>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。<br>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<br>不動産投信指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>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<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>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<br>(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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>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。<br><br>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。<br>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<br>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。<br><br>(2)為替予約取引による為替差損益<br>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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(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。<br><br>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。<br>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) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | うち1年超 | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(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<br>(120,167,490) | |
| 合計 | | | 79,629,062 | 90,340,824,295<br>(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<br>時価比率 | 合計金額に<br>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<br>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。<br>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<br>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。<br>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<br>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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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<br>(23,537,359,374) | |
| 合計 | | | | 23,537,359,374<br>(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<br>時価比率 | 合計金額に<br>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。<br>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<br>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。<br><br>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。<br>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<br>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<br>(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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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<br>(30,403,512,556) | |
| 合計 | | | 5,850,195 | 30,403,512,556<br>(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<br>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。<br>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<br>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。<br><br>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。<br>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<br>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<br>(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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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

（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 | 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<br>(21,678,539,278) | |
| 合計 | | | | 21,678,539,278<br>(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<br>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。<br>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<br>(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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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<br>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。<br>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<br>(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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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<br>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。<br>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<br>債券先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>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。<br><br>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。<br>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<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(2)為替予約取引による為替差損益<br>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。<br>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。<br>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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(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<br>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。<br><br>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。<br>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）】

### 【純資産額計算書】

（2023年 7月31日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 32,683,279,785円 |
| Ⅱ　負債総額 | 68,460,709円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 32,614,819,076円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 25,761,971,835口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.2660円 |
| （1万口当たり純資産額） | （12,660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。**

# 第三部【委託会社等の情報】

## 第１【委託会社等の概況】

### １【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2023年 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<br>（2022年3月31日） | | 当事業年度<br>（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<br>（2022年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>至　2022年3月31日） | （自　2022年4月1日<br>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<br>（自　2021年4月1日<br>至　2022年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2022年4月1日<br>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<br>（2022年3月31日） | | 当事業年度<br>（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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>（2022年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>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<br>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<br>（2022年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>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<br>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<br>（2022年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>（百万円） | 契約額等の<br>うち1年超<br>（百万円） | 時価<br>（百万円） | 評価損益<br>（百万円） |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>売建 | 12,195 | － | △9 | △9 |
| | 債券先物取引<br>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<br>会計の方法 | 種類 | 主なヘッジ対象 | 契約額等<br>（百万円） | 契約額等の<br>うち1年超<br>（百万円） | 時価<br>（百万円） |
|---|---|---|---|---|---|
| 原則的<br>処理方法 | 為替予約取引<br>売建 | | | | |
| | 米ドル | 投資有価証券<br>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<br>会計の方法 | 種類 | 主なヘッジ対象 | 契約額等<br>（百万円） | 契約額等の<br>うち1年超<br>（百万円） | 時価<br>（百万円） |
|---|---|---|---|---|---|
| 原則的<br>処理方法 | 為替予約取引<br>売建 | | | | |
| | 米ドル | 投資有価証券<br>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<br>（自　2021年4月1日<br>至　2022年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2022年4月1日<br>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<br>（2022年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>（自　2021年4月1日<br>至　2022年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2022年4月1日<br>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<br>（自　2021年4月1日<br>至　2022年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2022年4月1日<br>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<br>（2022年3月31日） | | 当事業年度<br>（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）<br>（2023年3月末日現在） | 事業の内容 |
|---|---|---|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 342,037 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。 |

**２【関係業務の概要】**

**(1)受託会社**

**当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。**

**(2)販売会社**

**当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。**

**３【資本関係】**

**(1)受託会社**

**該当事項はありません。**

**(2)販売会社**

**該当事項はありません。**

**(参考)再信託受託会社**

**①名称　　：株式会社日本カストディ銀行**
**②設立年月日　：2000年6月20日**
**③資本金の額　：51,000百万円（2023年3月末日現在）**
**④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。**
**⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。**

**第３【その他】**

**(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。**

**(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。**

**(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。**

**①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。**
**②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。**
**③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。**
**④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。**
**⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。**
**⑥ファンド名を「コア投資戦略ファンド」と表示する場合があります。**

**(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。**

**(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。**

**(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやＳＮＳのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。**

**(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。**

**(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。**

**(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。**

**(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。**

# 独立監査人の監査報告書

2023年６月２日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

| | |
|---|---|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士　三　上　和　彦 |
| 指定有限責任社員<br>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　　松崎雅則

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型）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）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。**